

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2009年10月28日設定）	
運用方針	外国債券インデックスマザーファンド受益証券を通じて、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

eMAXIS
 イーマックス

eMAXIS 先進国債券インデックス



第8期（決算日：2017年1月26日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「eMAXIS 先進国債券インデックス」は、去る1月26日に第8期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG

三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 URL:<http://www.am.mufig.jp/>

eMAXIS専用サイト URL:<http://emaxis.muam.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル **TEL. 0120-151034**
 (9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)
 お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税分配	み金	期中騰落	期中騰落	期中率			
	円	円	円	%	%	%	%	百万円	
4期(2013年1月28日)	10,805		0	23.9	88,978.51	25.4	98.6	—	2,756
5期(2014年1月27日)	12,269		0	13.5	101,648.63	14.2	98.5	—	4,027
6期(2015年1月26日)	13,952		0	13.7	116,771.41	14.9	98.7	—	9,998
7期(2016年1月26日)	13,590		0	△ 2.6	114,034.64	△ 2.3	98.8	—	20,643
8期(2017年1月26日)	12,865		0	△ 5.3	108,553.69	△ 4.8	98.7	—	23,176

(注) シティ世界国債インデックス (除く日本) は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) とは、シティ世界国債インデックス (除く日本) をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2016年1月26日	円 13,590	% —	114,034.64	% —	% 98.8	% —
1月末	14,017	3.1	117,720.03	3.2	97.9	—
2月末	13,294	△2.2	111,665.52	△2.1	98.9	—
3月末	13,525	△0.5	113,814.57	△0.2	101.9	—
4月末	13,083	△3.7	109,994.30	△3.5	98.9	—
5月末	13,194	△2.9	111,018.88	△2.6	98.8	—
6月末	12,459	△8.3	104,838.53	△8.1	98.9	—
7月末	12,656	△6.9	106,568.13	△6.5	98.7	—
8月末	12,555	△7.6	105,873.31	△7.2	98.2	—
9月末	12,313	△9.4	103,925.95	△8.9	99.0	—
10月末	12,327	△9.3	103,797.35	△9.0	98.8	—
11月末	12,818	△5.7	108,026.33	△5.3	98.6	—
12月末	13,211	△2.8	111,331.80	△2.4	98.5	—
(期 末) 2017年1月26日	12,865	△5.3	108,553.69	△4.8	98.7	—

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第8期：2016/1/27～2017/1/26)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ5.3%の下落となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-4.8%）を0.5%下回りました。

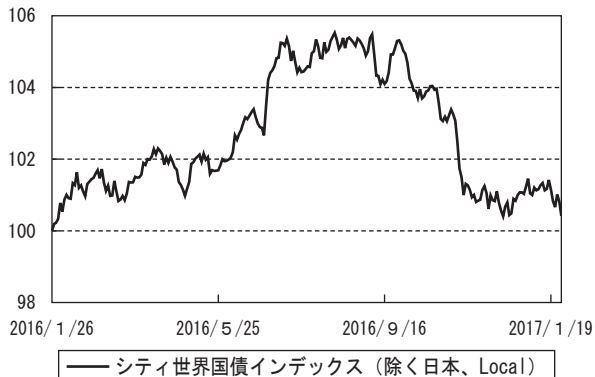


基準価額の主な変動要因

上昇要因	・先進国の債券市況の指標であるシティ世界国債インデックス（除く日本、Local）が期首と比較して上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	・2016年10月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルとユーロなどの通貨が対円で売られたことが、基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

(第8期：2016/1/27～2017/1/26)

債券市況の推移
(期首を100として指数化)

(注) シティ世界国債インデックス (除く日本) は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

為替市況の推移
(期首を100として指数化)

◎債券市況

- 世界的な景気減速懸念などを背景に、金利は総じて低下傾向にありましたが、その後の米大統領選の結果を受けて、米国を中心に金利が上昇しました。

◎為替市況

- 2016年10月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルとユーロは対円で売られました。その後、米大統領選の結果を受けて対円で上昇したものの、期を通じて見ると米ドルとユーロなどの主要通貨は対円で下落しました。
- 期首との比較では、米ドルは対円で4.2%下落しました。
- 期首との比較では、ユーロは対円で5.0%下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

< eMAXIS 先進国債券インデックス >

- ・当ファンドは、外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・債券の実質組入比率は運用の基本方針にしたがって高水準を維持しました。このため基準価額は、マザーファンドに組み入れられた資産の市況変動の影響を反映しています。

< 外国債券インデックスマザーファンド >

基準価額は期首に比べ4.7%の下落となりました。

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2016年1月26日）

最終利回り	1.2%
直接利回り	2.5%
デュレーション	6.7年

期末（2017年1月26日）

最終利回り	1.4%
直接利回り	2.4%
デュレーション	6.8年

- ・数値は債券現物部分で計算しております。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

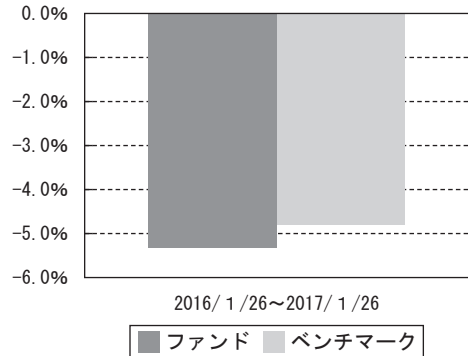
< eMAXIS 先進国債券インデックス >

- ・基準価額とベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.5\%$ 程度となりました。

	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.6\%$ 程度	0.1%程度	$\Delta 0.5\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

- ◎マザーファンド保有以外の要因
ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.6\%$ 程度でした。
- ◎マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は0.1%程度でした。

基準価額（ベビーファンド）と
ベンチマークの対比（騰落率）

< 外国債券インデックスマザーファンド >

ベンチマークは4.8%の下落となったため、カイ離は0.1%程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	0.1%程度	0.1%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

- ◎ポートフォリオ要因
ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。
- ◎管理コスト等要因
管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。
・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。
- ◎評価時価差異に基づく要因
評価時価差異による影響は0.1%程度でした。
・為替の効果および債券の効果による要因です。
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第8期
	2016年1月27日～2017年1月26日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,345

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

＜eMAXIS 先進国債券インデックス＞

- ・ファンドの資産のほぼ全額を外国債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、高い実質外国公社債組入比率を維持します。

＜外国債券インデックスマザーファンド＞

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(37)	(0. 284)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(38)	(0. 297)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(8)	(0. 064)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0. 019	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0. 015)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	86	0. 664	
期中の平均基準価額は、12,954円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2016年1月27日～2017年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 2,650,705	千円 5,244,287	千口 850,588	千円 1,652,505

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月27日～2017年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 先進国債券インデックス >

該当事項はございません。

< 外国債券インデックスマザーファンド >

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
		うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	20,859	3,537	17.0	36,444	12,350	33.9

平均保有割合 15.7%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 10,101,843	千口 11,901,960	千円 23,173,116	千円 23,173,116

○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 23,173,116	% 99.5
コール・ローン等、その他	125,478	0.5
投資信託財産総額	23,298,594	100.0

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(128,890,434千円)の投資信託財産総額(128,982,879千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=113.15円	1 カナダドル=86.66円	1 メキシコペソ=5.37円	1 ユーロ=121.76円
1 イギリスポンド=142.99円	1 スイスフラン=113.39円	1 スウェーデンクローネ=12.85円	1 ノルウェークローネ=13.64円
1 デンマーククローネ=16.37円	1 ポーランドズロチ=27.98円	1 オーストラリアドル=85.77円	1 シンガポールドル=80.16円
1 マレーシアリンギット=25.55円	1 南アフリカランド=8.55円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	23,298,594,454
コール・ローン等	96,397,685
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	23,173,116,170
未収入金	29,080,599
(B) 負債	122,318,436
未払解約金	45,545,036
未払信託報酬	76,315,434
未払利息	136
その他未払費用	457,830
(C) 純資産総額(A-B)	23,176,276,018
元本	18,015,415,565
次期繰越損益金	5,160,860,453
(D) 受益権総口数	18,015,415,565口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,865円

<注記事項>

- ①期首元本額 15,190,592,287円
 期中追加設定元本額 5,806,500,286円
 期中一部解約元本額 2,981,677,008円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,865円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年1月27日～ 2017年1月26日
費用控除後の配当等収益額	405,391,185円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	-円
収益調整金額	6,459,789,902円
分配準備積立金額	964,199,284円
当ファンドの分配対象収益額	7,829,380,371円
1万口当たり収益分配対象額	4,345円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

○損益の状況 (2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 21,046
受取利息	1,375
支払利息	△ 22,421
(B) 有価証券売買損益	△ 871,023,371
売買益	175,688,006
売買損	△1,046,711,377
(C) 信託報酬等	△ 148,839,961
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,019,884,378
(E) 前期繰越損益金	122,576,698
(F) 追加信託差損益金	6,058,168,133
(配当等相当額)	(6,449,194,122)
(売買損益相当額)	(△ 391,025,989)
(G) 計(D+E+F)	5,160,860,453
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	5,160,860,453
追加信託差損益金	6,058,168,133
(配当等相当額)	(6,459,789,902)
(売買損益相当額)	(△ 401,621,769)
分配準備積立金	1,369,590,469
繰越損益金	△2,266,898,149

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める（分散型に分類）ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年10月18日)
- ②純資産残高増大に応じた信託報酬率の引き下げを行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年10月18日)
- ③2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

<外国債券インデックスマザーファンド>

下記は、外国債券インデックスマザーファンド全体(65,998,579千円)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 492,200	千アメリカドル 494,536	千円 55,956,749	% 43.5	% —	% 17.7	% 17.6	% 8.2
カナダ	千カナダドル 29,300	千カナダドル 31,751	2,751,626	2.1	—	1.0	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 178,100	千メキシコペソ 179,604	964,478	0.8	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	65,720	76,963	9,371,057	7.3	—	4.0	2.2	1.1
イタリア	87,350	99,609	12,128,458	9.4	—	5.6	2.9	0.9
フランス	87,290	102,128	12,435,155	9.7	—	5.9	2.9	0.9
オランダ	20,700	24,299	2,958,760	2.3	—	1.4	0.5	0.4
スペイン	49,250	57,676	7,022,733	5.5	—	3.3	1.5	0.6
ベルギー	21,300	25,977	3,163,066	2.5	—	1.8	0.5	0.2
オーストリア	13,500	16,051	1,954,486	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	5,550	6,231	758,703	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	6,950	7,981	971,800	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 51,765	千イギリスポンド 64,076	9,162,359	7.1	—	5.1	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン 2,290	千スイスフラン 2,701	306,326	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 40,350	千スウェーデンクローネ 46,279	594,689	0.5	—	0.3	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 24,200	千ノルウェークローネ 25,832	352,350	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 40,050	千デンマーククローネ 50,278	823,054	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 27,600	千ポーランドズロチ 27,748	776,389	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 29,550	千オーストラリアドル 31,676	2,716,868	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 5,860	千シンガポールドル 6,049	484,920	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 21,950	千マレーシアリンギット 21,780	556,504	0.4	—	0.2	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 88,050	千南アフリカランド 81,640	698,025	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	126,908,564	98.8	—	51.3	33.4	14.1

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

(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,390	270,435	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	2,300	2,297	260,011	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180131	0.75	2,000	1,998	226,079	2018/1/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	3,500	3,494	395,406	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,000	1,996	225,849	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	1,800	1,795	203,184	2018/4/15
	0.75 T-NOTE 180430	0.75	200	199	22,572	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180831	0.75	2,700	2,685	303,846	2018/8/31
	0.75 T-NOTE 180930	0.75	2,800	2,782	314,877	2018/9/30
	0.75 T-NOTE 181031	0.75	1,000	992	112,341	2018/10/31
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	700	692	78,385	2019/2/15
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	3,000	2,954	334,265	2019/7/15
	0.75 T-NOTE 190815	0.75	2,800	2,754	311,684	2019/8/15
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	1,400	1,400	158,490	2018/1/15
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	2,000	2,000	226,344	2018/1/31
	0.875 T-NOTE 180331	0.875	1,800	1,799	203,582	2018/3/31
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	1,600	1,597	180,778	2018/5/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	2,200	2,195	248,375	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,500	2,488	281,582	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190415	0.875	2,000	1,980	224,063	2019/4/15
	0.875 T-NOTE 190515	0.875	2,000	1,978	223,886	2019/5/15
	0.875 T-NOTE 190615	0.875	1,800	1,779	201,354	2019/6/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	900	888	100,538	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	3,400	3,351	379,224	2019/9/15
	1 T-NOTE 171231	1.0	2,200	2,203	249,318	2017/12/31
	1 T-NOTE 180215	1.0	1,500	1,502	169,963	2018/2/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	2,100	2,102	237,847	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	1,700	1,700	192,392	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	2,600	2,600	294,190	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	2,700	2,697	305,182	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	2,600	2,595	293,626	2018/9/15
	1 T-NOTE 181130	1.0	300	298	33,829	2018/11/30
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,400	1,391	157,438	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	1,100	1,090	123,395	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	600	593	67,166	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,779	201,362	2019/9/30
	1 T-NOTE 191015	1.0	1,700	1,679	190,048	2019/10/15
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,800	1,775	200,933	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,203	249,328	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	1,800	1,796	203,248	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,591	180,113	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,700	1,681	190,243	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200331	1.125	1,600	1,577	178,522	2020/3/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	1,000	985	111,452	2020/4/30

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 210228	1.125	2,700	2,623	296,817	2021/2/28
		1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,200	2,126	240,645	2021/6/30
		1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,200	2,123	240,275	2021/7/31
		1.125 T-NOTE 210831	1.125	3,000	2,893	327,383	2021/8/31
		1.125 T-NOTE 210930	1.125	2,700	2,599	294,167	2021/9/30
		1.25 T-NOTE 181031	1.25	2,400	2,403	271,963	2018/10/31
		1.25 T-NOTE 181115	1.25	1,900	1,902	215,262	2018/11/15
		1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,502	283,173	2018/11/30
		1.25 T-NOTE 181215	1.25	2,400	2,401	271,761	2018/12/15
		1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,400	2,400	271,570	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	600	598	67,775	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	1,400	1,392	157,587	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	2,700	2,677	302,903	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,600	1,585	179,399	2020/2/29
		1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,900	1,853	209,694	2021/3/31
		1.25 T-NOTE 211031	1.25	600	580	65,678	2021/10/31
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,500	1,407	159,223	2023/7/31
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,800	1,809	204,696	2018/6/30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,300	2,311	261,525	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	3,200	3,213	363,607	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,100	1,103	124,858	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,000	2,006	227,033	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,200	1,202	136,061	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,900	1,891	214,044	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,500	2,485	281,217	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,100	2,085	236,018	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	2,000	1,984	224,549	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,000	1,982	224,337	2020/5/31
		1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,700	2,667	301,853	2020/8/31
		1.375 T-NOTE 200930	1.375	2,600	2,566	290,351	2020/9/30
		1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,600	2,563	290,029	2020/10/31
		1.375 T-NOTE 210131	1.375	2,300	2,259	255,670	2021/1/31
		1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,600	2,546	288,099	2021/4/30
		1.375 T-NOTE 210531	1.375	3,200	3,130	354,244	2021/5/31
		1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,500	2,366	267,803	2023/6/30
		1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,800	2,643	299,147	2023/8/31
		1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,300	2,170	245,545	2023/9/30
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	3,400	3,422	387,234	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,900	2,915	329,903	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,600	2,613	295,660	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,400	2,411	272,854	2019/2/28	
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,004	113,605	2019/3/31	
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,800	2,809	317,896	2019/5/31	
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	2,000	2,002	226,529	2019/10/31	
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,901	328,250	2019/11/30	

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券						
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	2,300	2,289	259,004	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,400	2,341	264,940	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	2,200	2,109	238,700	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,800	1,723	194,982	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,000	4,566	516,644	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	2,700	2,718	307,581	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,100	1,107	125,272	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,700	1,710	193,497	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,700	1,709	193,391	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,100	3,116	352,601	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,200	1,203	136,214	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	2,700	2,695	305,027	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	3,300	3,292	372,490	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	2,400	2,385	269,926	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,600	1,558	176,287	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,400	2,328	263,498	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,200	2,120	239,906	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	1,600	1,540	174,265	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,000	957	108,394	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,700	4,363	493,747	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	4,800	4,446	503,107	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	700	707	80,018	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,300	2,318	262,359	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	2,300	2,299	260,184	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	2,500	2,494	282,278	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,300	1,286	145,612	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,100	2,071	234,366	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,200	2,167	245,234	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,000	1,968	222,693	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,800	1,770	200,320	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	2,000	1,956	221,367	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,100	2,045	231,451	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,000	3,882	439,269	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,300	1,308	148,083	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,300	2,287	258,821	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,200	2,177	246,343	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	2,000	1,971	223,099	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,000	1,967	222,657	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,100	1,111	125,806	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,615	182,737	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,310	148,255	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,000	2,012	227,661	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	2,200	2,209	249,980	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	2,300	2,304	260,753	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	2,500	2,501	283,029	2021/10/31

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券						
2 T-NOTE 211115	2.0	3,400	3,401	384,830	2021/11/15	
2 T-NOTE 220215	2.0	2,200	2,197	248,667	2022/2/15	
2 T-NOTE 220731	2.0	2,000	1,987	224,938	2022/7/31	
2 T-NOTE 221130	2.0	2,000	1,979	224,001	2022/11/30	
2 T-NOTE 230215	2.0	4,000	3,951	447,154	2023/2/15	
2 T-NOTE 250215	2.0	4,900	4,739	536,329	2025/2/15	
2 T-NOTE 250815	2.0	4,700	4,525	512,111	2025/8/15	
2 T-NOTE 261115	2.0	2,600	2,482	280,882	2026/11/15	
2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,200	2,229	252,294	2020/8/31	
2.125 T-NOTE 210131	2.125	1,600	1,617	183,062	2021/1/31	
2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,600	2,623	296,833	2021/6/30	
2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,300	3,325	376,239	2021/8/15	
2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,517	284,819	2021/9/30	
2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,300	2,314	261,830	2021/12/31	
2.125 T-NOTE 220630	2.125	2,000	2,002	226,565	2022/6/30	
2.125 T-NOTE 221231	2.125	2,100	2,091	236,649	2022/12/31	
2.125 T-NOTE 231130	2.125	1,700	1,680	190,175	2023/11/30	
2.125 T-NOTE 250515	2.125	4,700	4,580	518,302	2025/5/15	
2.25 T-BOND 460815	2.25	3,100	2,578	291,765	2046/8/15	
2.25 T-NOTE 180731	2.25	800	814	92,135	2018/7/31	
2.25 T-NOTE 210331	2.25	2,000	2,031	229,818	2021/3/31	
2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,300	2,334	264,148	2021/4/30	
2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,100	2,128	240,826	2021/7/31	
2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,800	4,742	536,628	2024/11/15	
2.25 T-NOTE 251115	2.25	4,900	4,803	543,562	2025/11/15	
2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,323	149,789	2018/5/31	
2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,018	115,293	2018/6/30	
2.375 T-NOTE 201231	2.375	800	817	92,493	2020/12/31	
2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,300	4,297	486,278	2024/8/15	
2.5 T-BOND 450215	2.5	3,100	2,739	309,961	2045/2/15	
2.5 T-BOND 460215	2.5	2,650	2,333	264,006	2046/2/15	
2.5 T-BOND 460515	2.5	2,850	2,508	283,855	2046/5/15	
2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,600	3,647	412,686	2023/8/15	
2.5 T-NOTE 240515	2.5	5,300	5,354	605,832	2024/5/15	
2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,100	1,119	126,672	2018/1/31	
2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,500	1,531	173,298	2018/4/30	
2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,500	2,579	291,847	2020/8/15	
2.625 T-NOTE 201115	2.625	4,200	4,331	490,155	2020/11/15	
2.75 T-BOND 420815	2.75	1,700	1,595	180,573	2042/8/15	
2.75 T-BOND 421115	2.75	1,800	1,687	190,924	2042/11/15	
2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,300	1,322	149,686	2017/12/31	
2.75 T-NOTE 180228	2.75	900	917	103,867	2018/2/28	
2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,300	1,338	151,433	2019/2/15	
2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,900	5,036	569,855	2023/11/15	
2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,500	3,596	406,977	2024/2/15	

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ						
	国債証券					
	2.875 T-BOND 430515	2.875	3,200	3,069	347,257	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	3,200	3,051	345,305	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	1,400	1,337	151,293	2046/11/15
	2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,000	1,022	115,713	2018/3/31
	3 T-BOND 420515	3.0	1,300	1,280	144,923	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	3,200	3,136	354,923	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	3,150	3,081	348,681	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,200	3,127	353,876	2045/11/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,200	1,209	136,904	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,400	1,410	159,635	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,900	1,909	216,076	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,200	3,215	363,833	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,700	2,809	317,880	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,400	2,521	285,350	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,200	3,369	381,202	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,300	3,471	392,808	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,083	122,617	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,600	1,643	185,990	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,300	2,438	275,869	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	2,500	2,747	310,919	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	3,300	3,626	410,384	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	2,200	2,321	262,708	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	2,900	3,078	348,361	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,700	3,961	448,222	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,100	1,230	139,284	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,950	3,317	375,386	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,700	2,823	319,479	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,200	1,368	154,810	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	500	518	58,689	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	900	941	106,517	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	800	963	108,963	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,400	1,686	190,859	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	500	616	69,719	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	900	1,101	124,636	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,500	1,837	207,939	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,100	1,351	152,907	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,100	1,378	156,018	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	700	876	99,179	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	650	809	91,595	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,500	1,900	214,993	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,500	1,940	219,568	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	400	532	60,195	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	750	949	107,397	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	400	508	57,490	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,000	1,322	149,685	2031/2/15

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	771	87,310	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	700	899	101,803	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	600	799	90,519	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	600	747	84,592	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	500	702	79,443	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	500	673	76,150	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	800	1,020	115,497	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	701	79,354	2019/8/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	870	98,467	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,157	130,940	2019/2/15
小計					55,956,749	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 180501	0.25	1,100	1,093	94,795	2018/5/1
	0.5 CAN GOVT 180801	0.5	800	796	69,063	2018/8/1
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	1,200	1,194	103,475	2018/11/1
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	600	578	50,112	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,200	1,187	102,869	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,300	1,280	110,974	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	1,000	981	85,048	2021/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	300	274	23,746	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	1,200	1,207	104,633	2018/2/1
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	700	704	61,054	2018/3/1
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	1,200	1,208	104,757	2018/9/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	700	710	61,590	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,000	1,003	86,929	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	900	875	75,853	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	917	79,504	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,100	1,124	97,440	2019/9/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,100	1,144	99,203	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	950	1,008	87,414	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	950	1,020	88,478	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	850	906	78,529	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	250	272	23,624	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	871	75,485	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,100	1,189	103,040	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,250	1,511	131,008	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,600	1,707	148,005	2019/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,100	1,404	121,708	2041/6/1
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,000	1,047	90,740	2018/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,000	1,411	122,303	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	900	1,255	108,781	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	950	1,392	120,678	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	300	470	40,773	2027/6/1
小計					2,751,626	

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	19,200	22,029	118,300	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,700	5,593	30,037	2036/11/20	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	13,600	13,244	71,123	2018/6/14	
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	16,900	16,032	86,095	2019/12/11	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	6,900	6,061	32,548	2026/3/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	22,700	22,057	118,448	2021/6/10	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	8,300	7,988	42,900	2022/6/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	6,600	6,507	34,943	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	10,200	10,006	53,736	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	7,000	6,797	36,500	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	12,300	11,897	63,888	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	9,800	10,063	54,041	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	7,100	7,298	39,190	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	18,400	18,941	101,717	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,900	7,260	38,988	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	7,500	7,824	42,017	2038/11/18	
小 計					964,478		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,300	1,252	152,469	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,500	1,529	186,235	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	1,700	1,733	211,013	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	1,000	1,018	123,955	2021/10/8
		0 SCHATS 180316	—	1,100	1,108	134,961	2018/3/16
		0 SCHATS 180615	—	1,300	1,312	159,779	2018/6/15
		0.25 OBL 180413	0.25	1,500	1,517	184,732	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	1,400	1,434	174,687	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,600	1,647	200,577	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	2,000	2,058	250,692	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,100	2,137	260,273	2026/2/15
		0.5 OBL 180223	0.5	1,200	1,215	147,963	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,400	1,437	174,972	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,350	1,446	176,136	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,900	2,027	246,825	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,234	150,300	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,449	176,473	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,428	173,972	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,200	1,322	161,070	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,300	1,435	174,795	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,300	1,441	175,456	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,700	1,888	229,885	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,300	1,463	178,219	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,500	1,674	203,875	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,500	1,708	208,064	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,300	1,433	174,541	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,236	150,577	2021/9/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	2.5 BUND 210104	2.5	1,600	1,791	218,169	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,400	1,829	222,735	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,400	1,842	224,397	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,600	1,798	219,028	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,300	1,449	176,540	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,500	1,748	212,953	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,100	1,609	195,918	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,800	1,984	241,682	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,900	2,064	251,368	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	1,400	1,461	178,006	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,700	2,634	320,811	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,700	1,821	221,776	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	870	1,427	173,758	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	800	1,173	142,859	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,500	2,446	297,897	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,300	2,291	278,985	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,300	2,128	259,218	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,250	1,934	235,539	2028/1/4
6.25 BUND 240104	6.25	600	862	104,984	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	550	934	113,816	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	700	1,134	138,098	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 191015	0.05	200	199	24,306	2019/10/15
		0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	600	600	73,166	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	1,300	1,307	159,150	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	500	503	61,292	2018/10/15
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,100	1,095	133,427	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	900	911	110,929	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	400	382	46,523	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,100	1,116	136,003	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	908	110,648	2018/1/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,100	1,086	132,279	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	900	923	112,451	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,100	1,018	123,971	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,300	1,329	161,869	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,300	1,331	162,114	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,200	1,242	151,252	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,500	1,462	178,102	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,400	1,350	164,393	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,600	1,437	175,074	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,304	158,872	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	900	960	116,957	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	700	648	78,927	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,300	1,371	167,009	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,400	1,481	180,417	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	900	808	98,454	2047/3/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	400	333	40,587	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,050	1,055	128,497	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	2,200	2,308	281,142	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,400	1,492	181,766	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,565	190,649	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,100	2,381	289,933	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,500	1,702	207,314	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,600	2,964	360,901	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,500	1,723	209,840	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,700	1,924	234,292	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,000	2,347	285,774	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,498	304,203	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,100	2,324	283,067	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,900	2,137	260,222	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	700	733	89,333	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,200	2,354	286,676	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,000	2,187	266,379	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,700	1,920	233,788	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,600	1,914	233,165	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,750	2,102	256,024	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,300	1,565	190,658	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,000	2,371	288,724	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,100	2,558	311,482	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,500	1,867	227,405	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,100	1,407	171,382	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,400	1,687	205,499	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,900	2,362	287,692	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,750	2,302	280,329	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,400	1,849	225,171	2039/8/1
5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,650	2,166	263,823	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,100	2,753	335,205	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,700	2,116	257,651	2022/9/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,200	1,496	182,232	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,200	1,681	204,725	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,450	3,470	422,568	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,900	2,681	326,473	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	700	1,022	124,514	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,000	1,492	181,756	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O.A.T 180225	—	700	704	85,739	2018/2/25
		0 O.A.T 190225	—	700	707	86,118	2019/2/25
		0 O.A.T 200525	—	1,700	1,717	209,155	2020/5/25
		0 O.A.T 210525	—	1,600	1,610	196,054	2021/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	1,900	1,936	235,754	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	900	839	102,232	2026/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	2,200	2,255	274,669	2019/11/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	0.5 O.A.T 250525	0.5	2,400	2,367	288,261	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	2,100	2,026	246,795	2026/5/25
		1 O.A.T 180525	1.0	1,700	1,735	211,263	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	1,700	1,747	212,757	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	2,200	2,274	276,991	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	1,900	1,934	235,515	2025/11/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	950	879	107,089	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	1,850	1,874	228,189	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	2,400	2,627	319,865	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,400	2,621	319,250	2024/11/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	350	293	35,704	2066/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	2,300	2,580	314,261	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	2,100	2,375	289,244	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	2,500	2,761	336,214	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	2,350	2,695	328,207	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	2,200	2,575	313,580	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,200	3,702	450,823	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	3,000	3,475	423,176	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,700	2,164	263,536	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,800	3,150	383,575	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,800	3,462	421,586	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	2,600	2,899	353,081	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,000	3,505	426,863	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	2,700	2,853	347,416	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,000	2,817	343,116	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,090	1,623	197,631	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	850	1,279	155,796	2060/4/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	2,000	2,168	263,986	2018/10/25
4.25 O.A.T 190425	4.25	2,500	2,766	336,826	2019/4/25		
4.25 O.A.T 231025	4.25	3,300	4,174	508,301	2023/10/25		
4.5 O.A.T 410425	4.5	2,200	3,335	406,147	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	2,100	3,159	384,730	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	2,400	3,590	437,118	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	2,150	3,464	421,877	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	2,000	2,907	353,969	2025/10/25		
8.5 O.A.T 191025	8.5	900	1,122	136,627	2019/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	900	1,363	166,048	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	900	906	110,382	2018/4/15
		0 NETH GOVT 220115	—	300	303	36,894	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	1,400	1,433	174,493	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,000	984	119,916	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,100	1,091	132,943	2026/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,100	1,119	136,352	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,200	1,243	151,408	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,110	135,156	2023/7/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	2 NETH GOVT 240715	2.0	1,100	1,243	151,361	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,300	1,471	179,207	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	950	1,166	141,976	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	850	1,149	139,950	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,400	1,627	198,130	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	700	797	97,158	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	491	59,868	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,100	1,702	207,238	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,100	1,174	142,999	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,100	1,225	149,162	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,100	1,681	204,781	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	900	1,359	165,572	2028/1/15
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	700	1,016	123,802	2023/1/15
		スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,400	1,409
0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25			600	605	73,711	2019/1/31
0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75			1,300	1,328	161,719	2021/7/30
1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15			1,400	1,454	177,070	2020/7/30
1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3			1,000	979	119,204	2026/10/31
1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4			1,600	1,668	203,205	2020/1/31
1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6			1,600	1,642	199,958	2025/4/30
1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95			1,400	1,458	177,606	2026/4/30
1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95			1,400	1,394	169,751	2030/7/30
2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15			1,600	1,700	207,025	2025/10/31
2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75			1,900	2,026	246,689	2019/4/30
2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75			1,800	2,012	245,074	2024/10/31
2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9			600	604	73,629	2046/10/31
3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45			300	312	38,011	2066/7/30
3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75			1,500	1,607	195,753	2018/10/31
3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8			1,500	1,788	217,800	2024/4/30
4 SPAIN GOVT 200430	4.0			1,600	1,807	220,029	2020/4/30
4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1			1,600	1,705	207,658	2018/7/30
4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2			1,200	1,532	186,628	2037/1/31
4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3			1,600	1,793	218,334	2019/10/31
4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4			1,500	1,848	225,130	2023/10/31
4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5			1,400	1,467	178,733	2018/1/31
4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6			1,500	1,677	204,261	2019/7/30
4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65			1,800	2,279	277,595	2025/7/30
4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7			1,100	1,504	183,210	2041/7/30
4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8			1,200	1,514	184,440	2024/1/31
4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85			1,450	1,707	207,961	2020/10/31
4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9			1,300	1,817	221,320	2040/7/30
5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15			750	1,018	123,999	2028/10/31
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15			850	1,233	150,212	2044/10/31
5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4			1,600	2,047	249,250	2023/1/31
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5			1,800	2,204	268,446	2021/4/30

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,450	2,150	261,796	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,700	2,158	262,770	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,100	1,526	185,900	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,850	2,687	327,196	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,400	1,419	172,825	2025/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	900	915	111,480	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	700	669	81,499	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	800	820	99,870	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	450	413	50,383	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	150	156	19,064	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	200	191	23,298	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,100	1,249	152,091	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,200	1,393	169,712	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,000	1,092	133,034	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	350	433	52,809	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,400	1,612	196,293	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	750	1,062	129,397	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	800	842	102,630	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	900	988	120,335	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,100	1,336	162,749	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	550	752	91,605	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,300	1,572	191,496	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,200	1,490	181,499	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,350	2,031	247,329	2041/3/28
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	700	937	114,127	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	1,600	2,517	306,484	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,400	2,078	253,045	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	100	99	12,074	2023/7/15
		0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	500	510	62,152	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	700	706	85,998	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	500	515	62,715	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	700	742	90,434	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	200	195	23,838	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	600	661	80,569	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	900	999	121,756	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	500	530	64,539	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	450	538	65,579	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	500	687	83,746	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	700	840	102,358	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,150	1,351	164,585	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	700	838	102,149	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	250	407	49,633	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,000	1,150	140,047	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	900	1,361	165,783	2037/3/15
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	900	994	121,086	2019/3/15		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	900	945	115,159	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	800	1,110	135,185	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	550	863	105,094	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	200	197	24,091	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	411	50,047	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	395	48,198	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	300	288	35,093	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	100	103	12,560	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	205	25,041	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	435	53,064	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	400	438	53,395	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	300	337	41,097	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	447	54,467	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	400	487	59,342	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	561	68,422	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	500	580	70,678	2021/4/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	600	779	94,948	2025/7/4		
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	500	560	68,253	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	400	414	50,449	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	396	48,279	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	432	52,658	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	650	716	87,229	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	713	86,915	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	485	59,065	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	500	557	67,877	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	650	706	85,965	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	800	921	112,253	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	600	717	87,306	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	900	1,218	148,322	2025/3/13
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	600	702	85,476	2019/10/18		
小 計						50,764,221	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	1.25 GILT 180722	1.25	2,400	2,439	348,771	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	2,150	2,228	318,652	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	1,400	1,404	200,814	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	100	88	12,593	2047/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,176	311,279	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,200	2,310	330,401	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	2,100	2,211	316,181	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	1,600	1,688	241,424	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,700	1,837	262,702	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	900	1,073	153,444	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	1,500	1,673	239,300	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	1,730	2,140	306,036	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,800	2,332	333,459	2045/1/22	

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
国債証券	3.5 GILT 680722	3.5	1,500	2,288	327,234	2068/7/22
	3.75 GILT 190907	3.75	1,100	1,200	171,620	2019/9/7
	3.75 GILT 200907	3.75	1,200	1,342	191,964	2020/9/7
	3.75 GILT 210907	3.75	1,200	1,370	195,984	2021/9/7
	3.75 GILT 520722	3.75	1,300	1,889	270,164	2052/7/22
	4 GILT 220307	4.0	1,050	1,224	175,029	2022/3/7
	4 GILT 600122	4.0	930	1,504	215,096	2060/1/22
	4.25 GILT 271207	4.25	950	1,204	172,206	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	1,300	1,717	245,649	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	1,685	2,289	327,367	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	1,050	1,464	209,411	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	1,200	1,690	241,733	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,350	2,003	286,488	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	1,130	1,736	248,297	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	1,330	2,175	311,043	2055/12/7
	4.5 GILT 190307	4.5	1,300	1,418	202,769	2019/3/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,550	2,142	306,312	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,270	1,888	270,084	2042/12/7
	4.75 GILT 200307	4.75	1,400	1,590	227,448	2020/3/7
	4.75 GILT 301207	4.75	1,100	1,505	215,305	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	1,290	1,908	272,893	2038/12/7
	5 GILT 180307	5.0	1,200	1,264	180,817	2018/3/7
	5 GILT 250307	5.0	1,050	1,356	193,968	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	750	1,107	158,321	2028/12/7
	8 GILT 210607	8.0	900	1,189	170,084	2021/6/7
小計					9,162,359	
スイス			千スイスフラン	千スイスフラン		
国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	270	301	34,215	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	340	376	42,686	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 180108	3.0	500	518	58,837	2018/1/8
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	420	458	51,947	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	330	421	47,770	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	430	625	70,868	2028/4/8
小計					306,326	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	5,300	5,430	69,783	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,750	6,217	79,898	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,800	5,572	71,604	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,950	8,228	105,733	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,450	4,587	58,955	2039/3/30
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	7,200	7,942	102,056	2019/3/12
	5 SWD GOVT 201201	5.0	6,900	8,300	106,657	2020/12/1
小計					594,689	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,700	2,662	36,322	2026/2/19

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円		
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	3,000	3,043	41,512	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,200	4,368	59,580	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,300	3,647	49,754	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	5,400	6,017	82,073	2021/5/25
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,600	6,092	83,107	2019/5/22
小	計					352,350	
デンマーク				千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	3,700	3,757	61,513	2018/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	4,700	5,141	84,171	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	6,300	6,992	114,470	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	7,000	8,069	132,097	2021/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	7,400	8,317	136,159	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,650	16,013	262,146	2039/11/15
		7 DMK GOVT 241110	7.0	1,300	1,985	32,495	2024/11/10
小	計					823,054	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	2,200	2,132	59,678	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	2,300	2,191	61,316	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	2,000	1,932	54,057	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	1,900	1,920	53,725	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	2,800	2,522	70,576	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	500	445	12,451	2027/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	2,000	2,048	57,314	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	2,100	2,038	57,034	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,100	1,128	31,581	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	2,250	2,322	64,972	2023/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,000	1,090	30,503	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,500	1,627	45,524	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,300	1,458	40,804	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,650	1,862	52,117	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	600	709	19,844	2029/4/25
		POLAND 181025	—	2,400	2,319	64,885	2018/10/25
小	計					776,389	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	1,350	1,334	114,465	2020/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	950	895	76,827	2028/5/21
		2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,700	1,737	149,044	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,950	1,979	169,766	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,350	1,344	115,297	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	457	39,229	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	550	473	40,650	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	1,200	1,230	105,515	2018/10/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,000	2,093	179,585	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,000	1,033	88,606	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	300	284	24,443	2039/6/21

銘柄		当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
国債証券	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	700	728	62,513	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,400	2,708	232,293	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,000	2,156	184,971	2020/4/15	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	800	932	80,006	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,100	2,476	212,417	2027/4/21	
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,700	1,820	156,130	2019/3/15	
	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,400	1,450	124,450	2018/1/21	
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,650	1,946	166,946	2023/4/21	
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,150	2,469	211,786	2021/5/15	
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,800	2,120	181,918	2022/7/15	
小計					2,716,868		
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	500	496	39,807	2018/4/1	
	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	350	352	28,218	2019/10/1	
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	150	152	12,189	2020/7/1	
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	100	98	7,881	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	611	49,014	2021/6/1	
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	300	301	24,192	2025/6/1	
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	450	462	37,035	2019/6/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	400	415	33,276	2023/7/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	400	402	32,256	2042/4/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	150	150	12,084	2046/3/1	
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	103	8,276	2029/7/1	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	300	308	24,689	2030/9/1	
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	400	421	33,795	2024/9/1	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	350	371	29,739	2022/9/1	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	400	422	33,888	2020/9/1	
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	230	250	20,077	2033/9/1	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	380	416	33,369	2027/3/1	
	4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	300	313	25,127	2018/9/1	
小計					484,920		
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
国債証券	3.26 MALAYSIAGOV 180301	3.26	900	902	23,054	2018/3/1	
	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	878	22,443	2022/8/15	
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,165	29,769	2023/3/15	
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	900	898	22,965	2020/3/31	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	275	7,040	2027/5/31	
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	800	804	20,562	2018/9/28	
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	1,100	1,107	28,286	2019/10/31	
	3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	1,002	25,625	2020/10/15	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	600	559	14,300	2028/6/15	
	3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	600	605	15,479	2019/3/15	
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	900	895	22,880	2022/9/30	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	200	198	5,068	2023/8/17	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	600	539	13,791	2033/4/15	

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
国債証券	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	700	707	18,083	2020/7/31
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	481	12,306	2027/3/15
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	100	98	2,507	2026/11/30
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	1,150	1,133	28,957	2025/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	913	23,332	2021/9/30
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	600	558	14,266	2032/4/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,050	1,071	27,383	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,000	1,007	25,744	2024/7/15
	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	800	772	19,748	2031/6/30
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	400	404	10,344	2018/2/7
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	350	331	8,476	2035/5/31
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,200	1,231	31,463	2019/11/29
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,009	25,789	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	900	891	22,766	2030/4/15
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	200	198	5,066	2046/3/15
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	600	605	15,471	2043/9/30
	5.248 MALAYSIA 280915	5.248	200	213	5,443	2028/9/15
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	300	316	8,082	2019/7/30
小計					556,504	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	13,100	14,618	124,988	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	6,550	4,752	40,632	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	5,800	4,199	35,903	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,900	3,724	31,844	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	7,200	5,980	51,132	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	4,600	4,523	38,677	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	4,400	4,275	36,554	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	3,000	3,012	25,758	2018/12/21
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	6,900	6,306	53,919	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,300	4,854	41,507	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	6,900	6,316	54,006	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,900	5,485	46,901	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	9,400	8,716	74,523	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	2,700	2,579	22,053	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	2,400	2,294	19,621	2040/1/31
小計					698,025	
合計					126,908,564	

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

外国債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第15期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主要運用対象	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2012年5月14日)	13,365	2.3	74,734.13	2.1	98.7	—	158,535
12期(2013年5月13日)	17,815	33.3	99,491.98	33.1	98.8	—	195,142
13期(2014年5月12日)	18,707	5.0	104,415.94	4.9	98.8	—	185,030
14期(2015年5月12日)	20,959	12.0	117,169.90	12.2	98.8	—	159,683
15期(2016年5月12日)	19,674	△ 6.1	109,931.94	△ 6.2	98.9	—	156,155

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、シティ世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年5月12日	円	%	117,169.90	%	%	%
5月末	20,959	—	119,576.28	—	98.8	—
6月末	21,469	2.4	117,821.48	2.1	97.3	—
7月末	21,143	0.9	119,513.99	0.6	98.7	—
8月末	21,435	2.3	119,513.99	2.0	98.8	—
9月末	21,102	0.7	117,759.56	0.5	98.1	—
10月末	21,048	0.4	117,295.48	0.1	98.8	—
11月末	21,064	0.5	117,390.65	0.2	98.7	—
12月末	21,049	0.4	117,622.76	0.4	98.9	—
2016年1月末	20,757	△1.0	115,735.90	△1.2	98.5	—
2月末	21,077	0.6	117,720.03	0.5	97.9	—
3月末	20,000	△4.6	111,665.52	△4.7	98.9	—
4月末	20,359	△2.9	113,814.57	△2.9	101.9	—
5月末	19,703	△6.0	109,994.30	△6.1	98.9	—
(期 末) 2016年5月12日	19,674	△6.1	109,931.94	△6.2	98.9	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

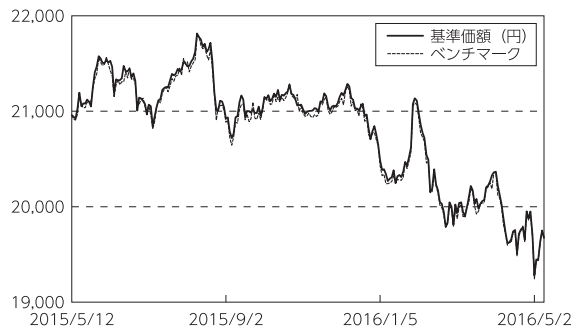
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(－6.2%)を0.1%上回りました。

基準価額の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎債券市況

- ・先進国の債券市況は、世界的な景気減速懸念や原油をはじめとする商品市況の悪化によるインフレ期待の低下などを背景に上昇しました。

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、FRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げが意識されて米ドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に米ドルが対円で売られました。期首との比較では、米ドルは対円で9.8%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で7.5%下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは6.2%の下落となったため、乖離は0.1%程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト等 要因	評価時価差異に 基づく要因	合計
ベンチマーク との乖離	△0.0%程度	△0.0%程度	0.1%程度	0.1%程度

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.0%程度でした。

- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・コストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

○今後の運用方針

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.016	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(3)	(0.016)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は、20,850円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 34,058	百万円 1,659	% 4.9	百万円 27,994	百万円 1,524	% 5.4

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額		うちBB格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 577,850	千アメリカドル 606,327	千円 65,707,749	% 42.1	% —	% 17.5	% 16.2	% 8.4
カナダ	千カナダドル 33,700	千カナダドル 38,093	3,212,411	2.1	—	1.0	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 219,600	千メキシコペソ 243,999	1,471,314	0.9	—	0.6	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	77,700	93,979	11,635,561	7.5	—	4.4	2.0	1.0
イタリア	104,600	124,581	15,424,452	9.9	—	6.2	2.8	0.9
フランス	101,500	123,991	15,351,399	9.8	—	6.1	2.8	0.9
オランダ	25,100	30,364	3,759,462	2.4	—	1.5	0.6	0.3
スペイン	58,700	69,178	8,564,969	5.5	—	3.1	1.7	0.7
ベルギー	25,900	32,740	4,053,611	2.6	—	1.9	0.5	0.2
オーストリア	15,950	19,540	2,419,359	1.5	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	6,800	7,768	961,757	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	8,700	10,254	1,269,585	0.8	—	0.4	0.4	0.0
イギリス	千イギリスポンド 63,885	千イギリスポンド 78,380	12,268,091	7.9	—	5.7	1.7	0.5
スイス	千スイスフラン 3,200	千スイスフラン 3,813	425,649	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 50,300	千スウェーデンクローネ 58,286	776,956	0.5	—	0.3	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 33,000	千ノルウェークローネ 35,935	477,220	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 49,500	千デンマーククローネ 63,757	1,060,921	0.7	—	0.5	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 30,900	千ポーランドズロチ 32,499	909,011	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 31,350	千オーストラリアドル 34,943	2,792,339	1.8	—	1.1	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,440	千シンガポールドル 6,808	539,944	0.3	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 26,250	千マレーシアリンギット 26,441	713,120	0.5	—	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 102,750	千南アフリカランド 92,584	667,536	0.4	—	0.3	0.1	0.0
合 計	—	—	154,462,427	98.9	—	52.9	31.5	14.5

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券	0.5	2,800	2,795	302,985	2017/7/31
	0.5 T-NOTE 170731	0.5	2,800	2,795	302,985	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	3,800	3,801	411,982	2017/5/31
	0.625 T-NOTE 170630	0.625	2,100	2,100	227,639	2017/6/30
	0.625 T-NOTE 170731	0.625	3,500	3,500	379,295	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	6,400	6,398	693,378	2017/8/31
	0.625 T-NOTE 170930	0.625	5,400	5,397	584,900	2017/9/30
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	2,800	2,797	303,151	2017/11/30
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,395	259,580	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	2,700	2,704	293,079	2017/6/30
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	5,500	5,505	596,663	2017/10/31
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	3,100	3,101	336,156	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180131	0.75	2,000	2,001	216,900	2018/1/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	4,000	4,002	433,767	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,900	2,901	314,481	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	1,800	1,800	195,165	2018/4/15
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	3,000	2,992	324,309	2019/2/15
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	3,800	3,812	413,141	2017/4/30
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	2,800	2,809	304,419	2017/5/15
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	2,700	2,708	293,501	2017/6/15
	0.875 T-NOTE 170715	0.875	1,800	1,805	195,660	2017/7/15
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	1,600	1,604	173,913	2017/8/15
	0.875 T-NOTE 171015	0.875	1,800	1,805	195,637	2017/10/15
	0.875 T-NOTE 171115	0.875	2,300	2,306	249,961	2017/11/15
	0.875 T-NOTE 171130	0.875	2,100	2,105	228,190	2017/11/30
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	1,400	1,403	152,138	2018/1/15
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	2,300	2,306	249,981	2018/1/31
	0.875 T-NOTE 180331	0.875	400	401	43,474	2018/3/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	2,200	2,205	239,000	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	3,600	3,606	390,878	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190415	0.875	2,800	2,800	303,518	2019/4/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	900	899	97,456	2019/7/31
	1 T-NOTE 170915	1.0	3,600	3,616	391,945	2017/9/15
	1 T-NOTE 171215	1.0	3,600	3,617	391,975	2017/12/15
	1 T-NOTE 171231	1.0	2,200	2,210	239,559	2017/12/31
	1 T-NOTE 180215	1.0	1,600	1,608	174,265	2018/2/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	2,100	2,111	228,777	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	2,200	2,211	239,652	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	2,700	2,714	294,153	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	3,000	3,015	326,773	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	2,600	2,613	283,225	2018/9/15
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,500	1,506	163,221	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	2,000	2,007	217,527	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	1,000	1,002	108,628	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,803	195,492	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,800	1,801	195,233	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,217	240,304	2018/6/15

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	1,800	1,814	196,597	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,612	174,733	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	2,600	2,612	283,104	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200331	1.125	2,000	2,007	217,501	2020/3/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,700	2,708	293,490	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,300	3,292	356,754	2021/2/28
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	2,400	2,426	262,953	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,100	3,134	339,634	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,527	273,909	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	2,000	2,022	219,169	2018/12/15
	1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,400	2,426	262,993	2019/1/31
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	1,500	1,517	164,421	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	2,800	2,828	306,529	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	3,500	3,530	382,554	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,800	1,814	196,673	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	2,300	2,305	249,854	2021/3/31
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,600	1,621	175,728	2018/6/30
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,000	2,027	219,669	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	2,500	2,535	274,777	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,200	1,217	131,898	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,000	2,029	219,931	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	2,100	2,131	230,963	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	2,300	2,330	252,600	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,800	2,835	307,252	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,800	2,834	307,205	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	3,700	3,744	405,793	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,400	2,428	263,196	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	3,100	3,132	339,463	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	3,500	3,534	383,058	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,500	2,524	273,528	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	3,500	3,530	382,584	2021/1/31
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	3,600	3,660	396,715	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,900	2,951	319,846	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,900	2,952	319,920	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,600	2,647	286,890	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,018	110,389	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,800	2,852	309,137	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,100	3,156	342,062	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	3,100	3,155	342,009	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	3,200	3,252	352,473	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	3,500	3,530	382,643	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	2,400	2,400	260,169	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	2,200	2,199	238,376	2023/3/31
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	3,000	3,065	332,247	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,100	2,146	232,626	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	2,600	2,659	288,189	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,700	1,738	188,431	2019/7/31

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,100	3,170	343,584	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	2,700	2,759	299,091	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	3,000	3,063	331,967	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	3,800	3,879	420,460	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	3,700	3,777	409,395	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,721	186,546	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,900	2,931	317,661	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,500	5,445	590,074	2026/2/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	500	511	55,465	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,800	2,875	311,590	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,500	3,590	389,103	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	2,700	2,769	300,165	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,700	2,758	298,976	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,600	2,655	287,793	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,800	2,858	309,765	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,500	2,551	276,555	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	2,300	2,342	253,827	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,500	2,541	275,475	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,300	4,372	473,891	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,900	1,930	209,176	2017/8/31
	1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,728	187,294	2017/9/30
	1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,543	275,655	2017/10/31
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,800	1,857	201,245	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,800	2,885	312,657	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,900	2,980	323,013	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	2,200	2,257	244,690	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	3,700	3,795	411,337	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,400	1,450	157,229	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,659	179,840	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,348	146,097	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,400	2,489	269,800	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	2,200	2,282	247,391	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	2,400	2,489	269,800	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	2,500	2,592	280,915	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	3,900	4,044	438,327	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	2,900	3,006	325,812	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,100	2,172	235,399	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	2,500	2,583	279,920	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	4,400	4,548	492,958	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	5,700	5,849	633,923	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	5,900	6,045	655,167	2025/8/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	3,000	3,124	338,647	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	2,300	2,398	259,961	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,300	2,401	260,233	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,300	3,444	373,322	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,608	282,735	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,800	2,921	316,640	2021/12/31

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.125 T-NOTE 220630	2.125	2,600	2,708	293,538	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	2,700	2,811	304,668	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	5,800	6,008	651,134	2025/5/15
	2.25 T-NOTE 171130	2.25	2,600	2,663	288,596	2017/11/30
	2.25 T-NOTE 180731	2.25	800	826	89,547	2018/7/31
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	2,000	2,099	227,509	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,800	2,939	318,536	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,300	2,415	261,733	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	5,900	6,179	669,703	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,300	6,588	714,040	2025/11/15
	2.375 T-NOTE 170731	2.375	2,900	2,961	320,914	2017/7/31
	2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,343	145,553	2018/5/31
	2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,034	112,120	2018/6/30
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	1,500	1,580	171,305	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	5,900	6,239	676,197	2024/8/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,400	3,343	362,297	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	3,400	3,343	362,355	2046/2/15
	2.5 T-NOTE 170630	2.5	2,400	2,451	265,645	2017/6/30
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,700	3,952	428,347	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	5,800	6,195	671,365	2024/5/15
	2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,500	1,549	167,882	2018/1/31
	2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,500	1,556	168,638	2018/4/30
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,500	2,655	287,815	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	4,200	4,469	484,330	2020/11/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,100	2,192	237,604	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	3,400	3,543	384,031	2042/11/15
	2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,100	1,124	121,898	2017/5/31
	2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,700	1,756	190,374	2017/12/31
	2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,500	1,554	168,441	2018/2/28
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,300	1,368	148,337	2019/2/15
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	5,800	6,302	683,052	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	4,400	4,781	518,215	2024/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,200	4,472	484,667	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	3,400	3,609	391,141	2045/8/15
	2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,400	1,456	157,863	2018/3/31
	3 T-BOND 420515	3.0	1,500	1,642	178,010	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	3,300	3,592	389,359	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	3,900	4,244	459,987	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,200	3,481	377,317	2045/11/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,100	1,234	133,828	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,500	1,683	182,391	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,500	3,914	424,188	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,200	3,571	386,989	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	2,100	2,151	233,204	2017/4/30
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,700	2,882	312,406	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,200	2,402	260,392	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,900	4,559	494,063	2044/5/15

銘柄	当	期	末	評 価 額		償還年月日		
				利 率	額面金額		外貨建金額	邦貨換算金額
							千アメリカドル	千円
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
国債証券	3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,300	3,575	387,460	2019/11/15		
	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,201	130,255	2039/2/15		
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,600	1,678	181,865	2018/2/15		
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,400	2,629	284,918	2020/5/15		
	3.625 T-BOND 430815	3.625	4,500	5,512	597,427	2043/8/15		
	3.625 T-BOND 440215	3.625	3,600	4,404	477,363	2044/2/15		
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	1,700	1,848	200,363	2019/8/15		
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	4,700	5,158	558,999	2020/2/15		
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,700	4,115	445,984	2021/2/15		
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,300	1,615	175,066	2041/8/15		
	3.75 T-BOND 431115	3.75	3,600	4,510	488,823	2043/11/15		
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,800	3,006	325,790	2018/11/15		
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,400	1,771	191,958	2040/8/15		
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,400	1,489	161,419	2018/5/15		
	4 T-NOTE 180815	4.0	900	967	104,855	2018/8/15		
	4.25 T-BOND 390515	4.25	800	1,068	115,820	2039/5/15		
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,400	1,870	202,745	2040/11/15		
	4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,500	1,580	171,273	2017/11/15		
	4.375 T-BOND 380215	4.375	500	681	73,860	2038/2/15		
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,300	1,765	191,323	2039/11/15		
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,300	1,765	191,367	2040/5/15		
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,700	2,316	251,055	2041/5/15		
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,300	1,797	194,845	2036/2/15		
	4.5 T-BOND 380515	4.5	800	1,108	120,134	2038/5/15		
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,100	1,520	164,775	2039/8/15		
	4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,100	1,143	123,900	2017/5/15		
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,800	2,529	274,159	2040/2/15		
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,600	2,292	248,478	2041/2/15		
	4.75 T-NOTE 170815	4.75	2,400	2,524	273,569	2017/8/15		
	5 T-BOND 370515	5.0	600	884	95,856	2037/5/15		
	5.25 T-BOND 281115	5.25	900	1,235	133,925	2028/11/15		
	5.25 T-BOND 290215	5.25	700	964	104,560	2029/2/15		
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,100	1,582	171,443	2031/2/15		
	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	837	90,751	2028/8/15		
	6 T-BOND 260215	6.0	700	971	105,319	2026/2/15		
	6.125 T-BOND 271115	6.125	650	939	101,800	2027/11/15		
	6.25 T-BOND 230815	6.25	600	797	86,403	2023/8/15		
	6.25 T-BOND 300515	6.25	700	1,070	116,040	2030/5/15		
	6.5 T-BOND 261115	6.5	500	728	78,902	2026/11/15		
	8 T-BOND 211115	8.0	1,200	1,629	176,616	2021/11/15		
	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	738	80,053	2019/8/15		
	8.75 T-BOND 170515	8.75	1,500	1,624	176,041	2017/5/15		
	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	922	99,997	2020/8/15		
	8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,221	132,325	2019/2/15		
小	計				65,707,749			
カナダ			千カナダドル	千カナダドル				
国債証券	0.25 CAN GOVT 170501	0.25	800	797	67,281	2017/5/1		

銘柄	銘柄	当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	0.25 CAN GOVT 171101	0.25	1,100	1,095	92,378	2017/11/1
		0.25 CAN GOVT 180501	0.25	800	795	67,092	2018/5/1
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,300	1,307	110,228	2020/9/1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,300	1,304	110,023	2021/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	400	400	33,735	2021/9/1
		1.25 CAN GOVT 170801	1.25	1,500	1,513	127,592	2017/8/1
		1.25 CAN GOVT 180201	1.25	1,600	1,619	136,580	2018/2/1
		1.25 CAN GOVT 180301	1.25	900	911	76,891	2018/3/1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	1,100	1,118	94,311	2018/9/1
		1.5 CAN GOVT 170901	1.5	1,100	1,113	93,924	2017/9/1
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	700	723	61,043	2020/3/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,200	1,243	104,873	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,100	1,120	94,530	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	930	78,492	2019/3/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	900	934	78,833	2019/9/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,100	1,199	101,154	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,350	1,496	126,196	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,200	1,334	112,507	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	650	769	64,888	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	350	439	37,051	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,000	1,126	94,968	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,200	1,338	112,863	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,400	1,882	158,734	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,600	1,753	147,889	2019/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	950	984	83,025	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,500	2,096	176,821	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,100	1,183	99,808	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	1,150	1,754	147,985	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	950	1,413	119,164	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,200	1,887	159,180	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	300	502	42,355	2027/6/1
小	計					3,212,411	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	22,400	28,726	173,220	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	5,200	7,219	43,533	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	17,700	17,787	107,258	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	9,700	9,794	59,061	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	12,700	12,658	76,330	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	5,200	5,134	30,962	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	20,900	21,925	132,209	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	9,700	10,160	61,265	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,700	8,575	51,707	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	14,300	15,120	91,179	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	12,200	13,782	83,108	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	7,400	8,367	50,453	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	12,800	14,575	87,888	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	10,900	12,025	72,513	2020/6/11

銘柄		当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	8,200	9,328	56,252	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	23,400	25,565	154,162	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	9,100	10,924	65,875	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	10,100	12,326	74,331	2038/11/18	
小 計					1,471,314		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	1,700	1,732	214,455	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	1,200	1,222	151,409	2021/4/9
		0 SCHATS 170616	—	1,400	1,407	174,287	2017/6/16
		0 SCHATS 170915	—	1,300	1,309	162,071	2017/9/15
		0 SCHATS 171215	—	1,100	1,108	137,294	2017/12/15
		0 SCHATS 180316	—	900	908	112,482	2018/3/16
		0.25 OBL 180413	0.25	1,500	1,522	188,491	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	1,800	1,847	228,696	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,600	1,649	204,236	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	2,200	2,298	284,543	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	1,500	1,554	192,447	2026/2/15
		0.5 OBL 171013	0.5	1,300	1,318	163,262	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,900	1,934	239,532	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,400	1,442	178,560	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,700	1,852	229,314	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	2,000	2,174	269,212	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,300	1,348	166,940	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,460	180,778	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	1,500	1,671	206,988	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,600	1,790	221,709	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,500	1,683	208,427	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,700	1,921	237,902	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,100	2,367	293,112	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,600	1,837	227,453	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	2,100	2,380	294,698	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,600	1,859	230,187	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,400	1,566	193,908	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,300	1,483	183,647	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,700	1,933	239,428	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,550	2,208	273,436	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,300	1,876	232,319	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,800	2,061	255,216	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	2,100	2,390	295,920	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,700	2,021	250,257	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,300	2,056	254,635	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	2,000	2,254	279,092	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	2,300	2,562	317,254	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	1,700	1,827	226,273	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	2,200	3,620	448,272	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	1,500	1,581	195,855	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,900	2,095	259,445	2018/7/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4.25 BUND 390704	4.25	1,000	1,752	216,933	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,150	1,773	219,538	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,850	3,190	394,971	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,600	3,016	373,430	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,400	2,414	298,914	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,350	2,194	271,708	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	900	1,345	166,608	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	900	1,617	200,237	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	900	1,532	189,758	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	1,900	1,911	236,638	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	700	705	87,299	2018/10/15
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	900	912	112,961	2020/11/1
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,200	1,222	151,313	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	1,500	1,520	188,259	2018/1/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	600	601	74,468	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	1,900	1,961	242,848	2019/12/1
		1.15 ITALY GOVT 170515	1.15	1,200	1,215	150,436	2017/5/15
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,800	1,869	231,404	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,500	1,561	193,329	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,300	1,358	168,220	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,900	1,920	237,732	2025/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,300	1,238	153,339	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,361	168,558	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,500	1,627	201,491	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	550	541	67,016	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,200	1,286	159,254	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	2,200	2,411	298,557	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	900	897	111,089	2047/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,200	1,340	165,954	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,500	1,578	195,465	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	2,300	2,466	305,365	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,600	1,742	215,776	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,000	2,381	294,865	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,000	2,317	286,892	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,400	1,625	201,258	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,600	3,034	375,648	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,800	2,149	266,148	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	2,000	2,316	286,843	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,300	2,894	358,359	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,565	317,596	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,600	2,953	365,685	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	2,400	2,770	342,978	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	2,200	2,372	293,736	2018/2/1
4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,200	2,420	299,661	2018/8/1		
4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,000	2,250	278,646	2019/3/1		
4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,400	2,785	344,835	2020/2/1		
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,400	1,737	215,081	2023/5/1		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,200	2,746	340,055	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,600	2,036	252,186	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	1,300	1,361	168,558	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,200	1,261	156,134	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,300	2,807	347,624	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,100	2,652	328,368	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	2,000	2,642	327,192	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,400	1,977	244,868	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,800	2,242	277,681	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	2,400	3,122	386,614	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,100	2,956	366,055	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,700	2,437	301,845	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,000	2,862	354,418	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	1,800	1,917	237,366	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,500	3,486	431,632	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	2,100	2,709	335,466	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,000	2,587	320,321	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,350	2,027	250,991	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,650	3,997	494,949	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,450	3,653	452,347	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,000	1,544	191,162	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,100	1,725	213,595	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	2,300	2,318	287,055	2018/2/25
		0 O. A. T 190225	—	500	505	62,597	2019/2/25
		0 O. A. T 200525	—	2,100	2,125	263,147	2020/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	2,000	2,044	253,129	2020/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	2,900	2,987	369,892	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	3,000	3,044	376,964	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	400	400	49,628	2026/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	1,600	1,628	201,612	2017/7/25
		1 O. A. T 180525	1.0	2,000	2,058	254,875	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	1,900	1,968	243,766	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	2,000	2,085	258,143	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	2,100	2,217	274,535	2025/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	600	601	74,494	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	900	970	120,103	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	2,700	3,028	375,003	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	2,500	2,818	348,927	2024/11/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	250	244	30,282	2066/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	2,600	2,985	369,676	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	3,300	3,850	476,784	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	3,300	3,708	459,154	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	2,500	3,045	377,063	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	3,900	4,818	596,596	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	3,700	4,386	543,119	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	4,000	4,745	587,527	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,650	2,352	291,322	2045/5/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	3.5 O.A.T 200425	3.5	3,200	3,685	456,254	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	3,300	4,288	530,940	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	3,000	3,429	424,581	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,100	3,711	459,556	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	3,200	3,479	430,739	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,450	3,755	464,996	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,400	2,362	292,466	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,050	1,799	222,742	2060/4/25
		4.25 O.A.T 171025	4.25	3,400	3,634	449,957	2017/10/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	2,700	3,011	372,880	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	2,500	2,845	352,347	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,700	4,855	601,160	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,300	3,850	476,764	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,300	3,736	462,554	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	2,500	3,977	492,392	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,700	4,673	578,650	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	2,100	3,210	397,541	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	1,000	1,308	161,993	2019/10/25
8.5 O.A.T 230425	8.5	900	1,433	177,472	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	900	908	112,437	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	1,400	1,436	177,814	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,400	1,405	173,957	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	500	507	62,876	2026/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,500	1,543	191,147	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,500	1,569	194,350	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,400	1,582	195,954	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,400	1,620	200,573	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,400	1,611	199,516	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,100	1,413	174,991	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,000	1,468	181,852	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,500	1,776	219,951	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,300	1,513	187,389	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	504	62,412	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,300	2,158	267,222	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,300	1,427	176,726	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,300	1,485	183,945	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,300	2,099	259,914	2037/1/15
4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,300	1,376	170,417	2017/7/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,200	1,897	234,974	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	700	1,058	131,036	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,600	1,610	199,344	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	400	402	49,860	2019/1/31
		0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	1,600	1,613	199,809	2017/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	200	202	25,019	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,600	1,654	204,860	2020/7/30
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	2,200	2,296	284,339	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,800	1,825	226,033	2025/4/30

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,100	1,135	140,535	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	750	740	91,682	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	1,400	1,430	177,104	2017/4/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,900	2,004	248,141	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,900	2,051	253,975	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,500	2,774	343,448	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	500	503	62,285	2046/10/31
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,700	1,859	230,177	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,900	2,261	279,969	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,000	2,292	283,834	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,800	1,966	243,416	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,500	1,901	235,412	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	2,000	2,286	283,042	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,600	1,978	244,985	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	2,200	2,372	293,777	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,700	1,944	240,733	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,700	2,161	267,642	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,250	1,702	210,794	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,500	1,901	235,440	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,600	1,914	237,091	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,200	1,672	207,079	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,500	2,034	251,922	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,150	1,680	208,104	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	2,000	2,587	320,407	2023/1/31
5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	1,900	2,029	251,329	2017/7/30		
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	2,100	2,617	324,078	2021/4/30		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,650	2,454	303,865	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,100	2,716	336,363	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,200	1,678	207,829	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,000	2,917	361,228	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,500	1,556	192,688	2025/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	600	627	77,740	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	100	99	12,365	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	1,100	1,140	141,202	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	350	349	43,294	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	250	276	34,208	2038/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,200	1,388	171,957	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,400	1,668	206,588	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,300	1,450	179,551	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	750	978	121,151	2034/6/22
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	1,300	1,358	168,203	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,600	1,887	233,634	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	800	1,229	152,212	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	1,000	1,084	134,271	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	1,100	1,242	153,780	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,300	1,619	200,450	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	800	1,152	142,718	2032/3/28

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,500	1,860	230,388	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,500	1,915	237,167	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,450	2,333	288,908	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	900	1,256	155,532	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,800	2,978	368,718	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 170928	5.5	600	649	80,436	2017/9/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,700	2,636	326,439	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	700	715	88,595	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	300	307	38,032	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	600	623	77,186	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	800	863	106,947	2025/10/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,000	1,124	139,205	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	800	904	111,934	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	600	643	79,731	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	500	618	76,539	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	650	946	117,201	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	900	1,106	137,013	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,350	1,620	200,588	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	800	981	121,576	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	300	539	66,747	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,200	1,414	175,166	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,050	1,655	204,906	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	700	744	92,235	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,000	1,136	140,672	2019/3/15
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	1,200	1,303	161,408	2018/1/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	800	1,147	142,054	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	700	1,143	141,613	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	500	514	63,703	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	403	49,947	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	300	297	36,881	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	300	314	38,998	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	300	311	38,532	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	441	54,696	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	500	554	68,615	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	400	458	56,813	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	400	547	67,825	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	500	626	77,622	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	573	70,967	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	500	592	73,363	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	600	635	78,672	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	600	803	99,520	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	600	691	85,596	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	500	517	64,059	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	405	50,172	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	467	57,884	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	700	799	98,956	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	700	849	105,161	2024/3/18

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
アイルランド	国債証券	3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	500	617	76,502	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	700	800	99,138	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	750	838	103,763	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,000	1,180	146,139	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	800	977	121,051	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,100	1,533	189,897	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	500	542	67,120	2017/10/18
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	600	724	89,737	2019/10/18
小 計						63,440,158	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	1 GILT 170907	1.0	2,600	2,621	410,329	2017/9/7	
	1.25 GILT 180722	1.25	2,600	2,649	414,724	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,900	1,960	306,874	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	500	498	78,083	2026/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,180	341,231	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,200	2,301	360,218	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	2,500	2,633	412,156	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	2,000	2,105	329,615	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	2,000	2,153	337,003	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	350	392	61,492	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	2,100	2,341	366,475	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	2,200	2,642	413,539	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	2,150	2,705	423,491	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	1,750	2,524	395,128	2068/7/22	
	3.75 GILT 190907	3.75	1,800	1,994	312,149	2019/9/7	
	3.75 GILT 200907	3.75	1,500	1,698	265,794	2020/9/7	
	3.75 GILT 210907	3.75	1,700	1,958	306,555	2021/9/7	
	3.75 GILT 520722	3.75	1,300	1,821	285,110	2052/7/22	
	4 GILT 220307	4.0	1,300	1,532	239,857	2022/3/7	
	4 GILT 600122	4.0	1,150	1,775	277,934	2060/1/22	
	4.25 GILT 271207	4.25	1,100	1,410	220,733	2027/12/7	
	4.25 GILT 320607	4.25	1,800	2,368	370,708	2032/6/7	
	4.25 GILT 360307	4.25	1,885	2,527	395,589	2036/3/7	
	4.25 GILT 390907	4.25	1,300	1,780	278,741	2039/9/7	
	4.25 GILT 401207	4.25	1,750	2,422	379,132	2040/12/7	
	4.25 GILT 461207	4.25	1,550	2,238	350,310	2046/12/7	
	4.25 GILT 491207	4.25	1,250	1,862	291,557	2049/12/7	
	4.25 GILT 551207	4.25	1,600	2,524	395,144	2055/12/7	
	4.5 GILT 190307	4.5	1,500	1,673	261,967	2019/3/7	
	4.5 GILT 340907	4.5	2,000	2,740	428,864	2034/9/7	
	4.5 GILT 421207	4.5	1,700	2,470	386,753	2042/12/7	
	4.75 GILT 200307	4.75	1,800	2,083	326,095	2020/3/7	
	4.75 GILT 301207	4.75	1,600	2,192	343,242	2030/12/7	
	4.75 GILT 381207	4.75	1,350	1,963	307,307	2038/12/7	
5 GILT 180307	5.0	1,900	2,063	323,052	2018/3/7		
5 GILT 250307	5.0	1,550	2,030	317,777	2025/3/7		
6 GILT 281207	6.0	1,100	1,652	258,662	2028/12/7		

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	8 GILT 210607	8.0	1,100	1,494	233,912	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	350	388	60,769	2017/8/25
小 計						12,268,091	
スイス			千スイスフラン	千スイスフラン			
	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	320	364	40,708	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	450	508	56,751	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	550	584	65,270	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	490	548	61,180	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	440	578	64,623	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	500	754	84,194	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	450	474	52,920	2017/6/5
小 計						425,649	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ			
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	4,300	4,419	58,918	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	6,800	7,382	98,409	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	5,500	6,469	86,240	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	7,700	9,265	123,506	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	4,000	5,400	71,990	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	5,700	6,011	80,135	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	8,100	9,185	122,437	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	8,200	10,151	135,318	2020/12/1
	小 計						776,956
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ			
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,000	2,030	26,959	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	3,400	3,540	47,023	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,600	4,887	64,912	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,200	4,779	63,467	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	6,600	7,532	100,028	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	5,800	6,015	79,889	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	6,400	7,149	94,940	2019/5/22
小 計						477,220	
デンマーク			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ			
	国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	3,000	3,048	50,728	2018/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	5,200	5,743	95,565	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	6,500	7,321	121,826	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	8,200	9,609	159,910	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	4,700	5,020	83,533	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	8,400	9,685	161,161	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	11,400	20,004	332,878	2039/11/15
	7 DMK GOVT 241110	7.0	2,100	3,324	55,316	2024/11/10	
小 計						1,060,921	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
	国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	2,600	2,553	71,416	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	1,100	1,069	29,917	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	2,400	2,377	66,486	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	2,200	2,241	62,681	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	2,000	1,909	53,403	2026/7/25

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ポーランド		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
国債証券	3.25 POLAND 190725	3.25	1,900	1,985	55,542	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,600	2,674	74,812	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	1,700	1,771	49,546	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	2,400	2,610	73,015	2023/10/25
	5.25 POLAND 171025	5.25	2,100	2,212	61,882	2017/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	1,500	1,706	47,732	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,800	2,020	56,508	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,400	1,647	46,081	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	2,000	2,383	66,674	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	800	1,003	28,076	2029/4/25
	POLAND 170725	—	1,200	1,179	32,991	2017/7/25
	POLAND 181025	—	1,200	1,152	32,241	2018/10/25
小計					909,011	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	1,100	1,100	87,904	2020/11/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,700	1,764	140,980	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,200	2,291	183,096	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	800	825	65,998	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	486	38,890	2035/6/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	1,300	1,351	107,968	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,300	2,484	198,553	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	800	862	68,913	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	400	411	32,883	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	750	839	67,052	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,550	1,596	127,603	2017/7/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,500	2,929	234,096	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,100	2,326	185,907	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	950	1,173	93,772	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,300	2,825	225,824	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	2,200	2,422	193,582	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	2,100	2,235	178,656	2018/1/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,900	2,321	185,483	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,900	2,256	180,318	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,000	2,438	194,850	2022/7/15
小計					2,792,339	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	0.5 SINGAPORGGOVT 180401	0.5	600	594	47,129	2018/4/1
	1.375 SINGAPORGGOV 171001	1.375	100	100	7,985	2017/10/1
	1.625 SINGAPORGGOV 191001	1.625	150	152	12,057	2019/10/1
	2 SINGAPORGGOVT 200701	2.0	250	256	20,343	2020/7/1
	2.25 SINGAPORGGOVT 210601	2.25	600	618	49,091	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGGOV 250601	2.375	150	154	12,283	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGGOVT 190601	2.5	600	624	49,498	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGGOVT 230701	2.75	400	422	33,516	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGGOVT 420401	2.75	450	475	37,723	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGGOVT 460301	2.75	150	157	12,462	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGGOV 290701	2.875	150	160	12,722	2029/7/1

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	2.875	400	425	33,779	2030/9/1
		3.0	600	646	51,259	2024/9/1
		3.125	470	508	40,306	2022/9/1
		3.25	400	430	34,157	2020/9/1
		3.375	200	227	18,050	2033/9/1
		3.5	470	531	42,177	2027/3/1
		4.0	300	320	25,399	2018/9/1
小	計				539,944	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.26	900	903	24,360	2018/3/1
		3.314	1,100	1,105	29,819	2017/10/31
		3.418	900	879	23,730	2022/8/15
		3.48	1,200	1,173	31,654	2023/3/15
		3.492	900	899	24,256	2020/3/31
		3.502	800	750	20,252	2027/5/31
		3.58	800	806	21,742	2018/9/28
		3.654	700	705	19,027	2019/10/31
		3.659	1,000	1,007	27,185	2020/10/15
		3.733	600	572	15,435	2028/6/15
		3.759	450	456	12,311	2019/3/15
		3.795	900	898	24,244	2022/9/30
		3.8	200	200	5,400	2023/8/17
		3.844	300	281	7,590	2033/4/15
		3.889	700	710	19,154	2020/7/31
		3.892	500	488	13,177	2027/3/15
		3.955	1,150	1,154	31,131	2025/9/15
		4.012	1,500	1,520	40,997	2017/9/15
		4.048	900	915	24,688	2021/9/30
		4.127	700	682	18,399	2032/4/15
		4.16	1,200	1,228	33,138	2021/7/15
		4.181	1,400	1,423	38,381	2024/7/15
		4.232	300	301	8,128	2031/6/30
		4.24	1,200	1,224	33,022	2018/2/7
		4.254	350	347	9,376	2035/5/31
		4.378	1,900	1,960	52,866	2019/11/29
		4.392	1,000	1,026	27,696	2026/4/15
		4.498	1,200	1,229	33,155	2030/4/15
		4.935	600	619	16,699	2043/9/30
		5.248	200	219	5,909	2028/9/15
		5.734	700	748	20,186	2019/7/30
小	計				713,120	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	10.5	15,000	16,338	117,800	2026/12/21
		6.25	7,350	5,129	36,980	2036/3/31
		6.5	7,200	4,977	35,889	2041/2/28
		6.75	5,700	5,267	37,981	2021/3/31
		7.0	8,000	6,367	45,912	2031/2/28

銘柄	当 期 末				償還年月日	
	利 率	額面金額	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
南アフリカ	%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円		
国債証券	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	5,500	5,280	38,069	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,000	4,701	33,899	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	4,100	4,074	29,374	2018/12/21
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	8,500	7,491	54,016	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	5,000	5,021	36,207	2017/9/15
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,800	5,123	36,938	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	7,000	6,179	44,556	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,000	4,440	32,014	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	9,700	8,597	61,984	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRICA 350228	8.875	2,500	2,308	16,641	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,400	1,285	9,268	2040/1/31
小 計					667,536	
合 計					154,462,427	

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	154,462,427	98.7
コール・ローン等、その他	2,009,882	1.3
投資信託財産総額	156,472,309	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (156,139,125千円) の投資信託財産総額 (156,472,309千円) に対する比率は99.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 メキシコペソ=6.03円	1 ユーロ=123.81円
1 イギリスポンド=156.52円	1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円
1 デンマーククローネ=16.64円	1 ポーランドズロチ=27.97円	1 オーストラリアドル=79.91円	1 シンガポールドル=79.31円
1 マレーシアリングgit=26.97円	1 南アフリカランド=7.21円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	156,494,614,094
コール・ローン等	682,983,499
公社債(評価額)	154,462,427,243
未収入金	22,304,800
未収利息	1,211,101,821
前払費用	115,796,731
(B) 負債	338,964,146
未払金	312,238,067
未払解約金	26,725,867
未払利息	87
その他未払費用	125
(C) 純資産総額(A-B)	156,155,649,948
元本	79,369,567,734
次期繰越損益金	76,786,082,214
(D) 受益権総口数	79,369,567,734口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,674円

<注記事項>

- ①期首元本額 76,187,578,939円
 期中追加設定元本額 20,858,565,795円
 期中一部解約元本額 17,676,577,000円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9674円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

ファンド・マネジャー(海外債券)	1,807,611,362円
eMAXIS 先進国債券インデックス	11,534,490,043円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,137,218,484円
eMAXIS バランス(波乗り型)	226,352,324円
コアバランス	1,700,783円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	6,437,009,006円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	16,634,896,304円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,373,592,301円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,212,693,687円
MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	13,634,758,617円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	9,105,298,351円
三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定)	2,745,502,453円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	650,178,523円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	218,583,584円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	80,427,144円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,835,690,297円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	43,989,417円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	7,156,437円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	14,999,999円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	25,991,372円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	9,528,671円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	164,114,246円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	72,157,907円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	148,729,507円

○損益の状況 (2015年5月13日~2016年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,659,008,119
受取利息	3,659,020,893
支払利息	△ 12,774
(B) 有価証券売買損益	△13,252,708,283
売買益	3,569,021,473
売買損	△16,821,729,756
(C) 保管費用等	△ 24,140,834
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 9,617,840,998
(E) 前期繰越損益金	83,496,410,946
(F) 追加信託差損益金	22,468,546,126
(G) 解約差損益金	△19,561,033,860
(H) 計(D+E+F+G)	76,786,082,214
次期繰越損益金(H)	76,786,082,214

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	134,129,874円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	267,768,500円
外国債券インデックスファンドi (適格機関投資家限定)	2,079,264,410円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	2,023,133,189円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	197,198,794円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	514,854,998円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	351,395,677円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	116,981,812円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	240,934,647円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	294,341,698円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	24,926円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	24,156円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	23,736円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	15,888,517円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	2,317,658円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	6,470,155円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	954,709円
eMAXIS 最適化バランス (マイフoward)	1,152,296円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	37,163円
合計	79,369,567,734円

【お知らせ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
(2016年3月2日)