

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（2007年10月31日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、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。なお、日本を除く世界各国の公社債に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。

## 運用報告書（全体版）

### ファンド・マネジャー （海外債券）



第10期（決算日：2017年3月27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「ファンド・マネジャー（海外債券）」は、去る3月27日に第10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。



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.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客様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)  
お客様の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
		税込み	分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率			
	円	円	円	%		%	%	%	百万円
6期(2013年3月25日)	10,084		0	18.9	91,625.28	19.2	98.8	—	550
7期(2014年3月25日)	11,305		0	12.1	103,029.21	12.4	98.8	—	2,442
8期(2015年3月25日)	12,858		0	13.7	117,822.55	14.4	98.8	—	2,078
9期(2016年3月25日)	12,251		0	△ 4.7	112,839.25	△ 4.2	98.5	—	3,385
10期(2017年3月27日)	11,597		0	△ 5.3	107,002.70	△ 5.2	100.4	—	2,624

(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 %
	円	騰 落 率 %	騰 落 率 %	騰 落 率 %		
(期 首) 2016年3月25日	12,251	—	112,839.25	—	98.5	—
3月末	12,344	0.8	113,814.57	0.9	101.9	—
4月末	11,943	△2.5	109,994.30	△2.5	98.9	—
5月末	12,048	△1.7	111,018.88	△1.6	98.8	—
6月末	11,379	△7.1	104,838.53	△7.1	98.9	—
7月末	11,559	△5.6	106,568.13	△5.6	98.7	—
8月末	11,469	△6.4	105,873.31	△6.2	98.2	—
9月末	11,251	△8.2	103,925.95	△7.9	99.0	—
10月末	11,264	△8.1	103,797.35	△8.0	98.8	—
11月末	11,715	△4.4	108,026.33	△4.3	98.6	—
12月末	12,077	△1.4	111,331.80	△1.3	98.5	—
2017年1月末	11,784	△3.8	108,860.69	△3.5	98.9	—
2月末	11,720	△4.3	108,568.93	△3.8	99.0	—
(期 末) 2017年3月27日	11,597	△5.3	107,002.70	△5.2	100.4	—

(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10期：2016/3/26～2017/3/27）

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（-5.2%）を0.1%下回りました。

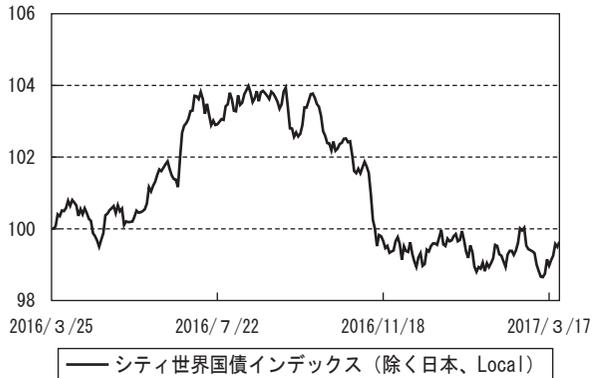


### 基準価額の主な変動要因

下落要因	<ul style="list-style-type: none"> <li>先進国の債券市況が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。</li> <li>世界的に景気減速懸念が強まったことや欧州中央銀行（ECB）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たことや、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たことが、基準価額の下落要因となりました。</li> </ul>
------	---

投資環境について

債券市況の推移  
(期首を100として指数化)



（第10期：2016/3/26～2017/3/27）

◎外国債券市況

- ・外国債券市況は、2016年6月までは世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に上昇しましたが、その後、米連邦準備制度理事会（FRB）による政策金利の引き上げ期待が高まったことなどを背景に下落しました。

為替市況の推移  
(期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、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2.5%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、世界的に景気減速懸念が強まったことやECB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5.3%下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<ファンド・マネジャー（海外債券）>

- ・マザーファンドを主要投資対象とし、これを通じ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4.9%の下落となりました。

- ・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。

（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3月25日）

期末（2017年3月27日）

最終利回り	1.1%	➡	最終利回り	1.4%
直接利回り	2.5%		直接利回り	2.5%
デュレーション	6.9年		デュレーション	7.0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

<ファンド・マネジャー（海外債券）>

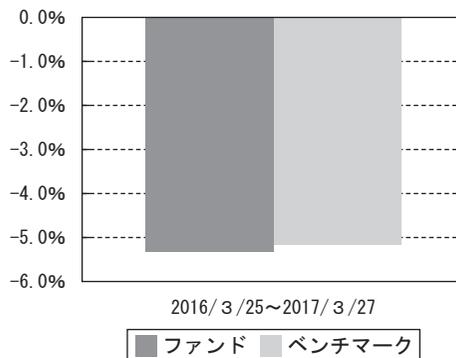
・ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

	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	$\Delta 0.4\%$ 程度	0.3%程度	$\Delta 0.1\%$ 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。

- ◎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 $\Delta 0.4\%$ 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0.3%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5.2%の下落となったため、カイ離は0.3%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	0.2%程度	0.3%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0.2%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10期
	2016年3月26日～2017年3月27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	3,686

（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

<ファンド・マネジャー（海外債券）>

- ・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3月26日～2017年3月27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 )	(31)	(0.266)	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 )	( 6 )	(0.053)	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 )	( 6 )	(0.053)	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	0.018	(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 )	( 0 )	(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	46	0.391	
期中の平均基準価額は、11,712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3月26日～2017年3月27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 709,352	千円 1,385,412	千口 1,018,981	千円 1,920,673

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月26日～2017年3月27日)

利害関係人との取引状況

<ファンド・マネジャー（海外債券）>

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	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			B A			D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	19,008	4,301	22.6	40,510	14,135	34.9

平均保有割合 2.2%

※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3月27日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数		口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	1,675,618	千口	1,365,988	千円 2,623,927

○投資信託財産の構成

(2017年3月27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 2,623,927	% 99.6
コール・ローン等、その他	10,380	0.4
投資信託財産総額	2,634,307	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（120,527,653千円）の投資信託財産総額（122,681,464千円）に対する比率は98.2%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=110.44円	1カナダドル=82.78円	1メキシコペソ=5.88円	1ユーロ=119.76円
1イギリスポンド=138.25円	1スイスフラン=111.80円	1スウェーデンクローネ=12.57円	1ノルウェークローネ=13.04円
1デンマーククローネ=16.10円	1ポーランドズロチ=28.07円	1オーストラリアドル=84.28円	1シンガポールドル=79.11円
1マレーシアリングgit=24.97円	1南アフリカランド=8.90円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年3月27日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,634,307,821
コール・ローン等	9,294,918
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,623,927,703
未収入金	1,085,200
(B) 負債	10,131,011
未払解約金	5,034,031
未払信託報酬	5,045,137
未払利息	11
その他未払費用	51,832
(C) 純資産総額(A-B)	2,624,176,810
元本	2,262,709,388
次期繰越損益金	361,467,422
(D) 受益権総口数	2,262,709,388口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,597円

<注記事項>

- ①期首元本額 2,763,585,169円  
 期中追加設定元本額 1,653,427,722円  
 期中一部解約元本額 2,154,303,503円  
 また、1口当たり純資産額は、期末11,597円です。

○損益の状況（2016年3月26日～2017年3月27日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,379
受取利息	65
支払利息	△ 2,444
(B) 有価証券売買損益	△ 86,130,771
売買益	99,897,402
売買損	△186,028,173
(C) 信託報酬等	△ 11,882,183
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 98,015,333
(E) 前期繰越損益金	△ 42,625,480
(F) 追加信託差損益金	502,108,235
(配当等相当額)	( 725,230,090)
(売買損益相当額)	(△223,121,855)
(G) 計(D+E+F)	361,467,422
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	361,467,422
追加信託差損益金	502,108,235
(配当等相当額)	( 728,007,354)
(売買損益相当額)	(△225,899,119)
分配準備積立金	106,228,795
繰越損益金	△246,869,608

- (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。

②分配金の計算過程

項 目	2016年3月26日～ 2017年3月27日
費用控除後の配当等収益額	52,463,050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	728,007,354円
分配準備積立金額	53,765,745円
当ファンドの分配対象収益額	834,236,149円
1万口当たり収益分配対象額	3,686円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

\*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12月23日)
- ②2014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3月27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（62,642,240千口）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 483,300	千アメリカドル 487,626	千円 53,853,465	% 44.8	% —	% 18.1	% 18.3	% 8.3
カナダ	千カナダドル 28,450	千カナダドル 30,967	2,563,524	2.1	—	0.9	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 176,300	千メキシコペソ 182,863	1,075,239	0.9	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	61,820	72,821	8,721,098	7.2	—	4.1	2.1	1.0
イタリア	83,550	93,853	11,239,945	9.3	—	5.5	2.8	1.1
フランス	85,040	99,087	11,866,703	9.9	—	6.2	2.8	0.8
オランダ	19,450	23,143	2,771,606	2.3	—	1.5	0.5	0.3
スペイン	47,800	55,449	6,640,680	5.5	—	3.3	1.7	0.5
ベルギー	21,250	25,871	3,098,342	2.6	—	1.9	0.5	0.2
オーストリア	12,300	14,704	1,761,044	1.5	—	1.0	0.3	0.1
フィンランド	5,550	6,217	744,566	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	7,000	7,963	953,701	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 50,015	千イギリスポンド 63,546	8,785,320	7.3	—	5.1	1.6	0.6
スイス	千スイスフラン 1,670	千スイスフラン 2,019	225,764	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 38,050	千スウェーデンクローネ 43,670	548,939	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 23,750	千ノルウェークローネ 25,411	331,360	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 35,500	千デンマーククローネ 44,400	714,854	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 27,800	千ポーランドズロチ 28,209	791,830	0.7	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 27,650	千オーストラリアドル 29,599	2,494,658	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 5,750	千シンガポールドル 6,003	474,972	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 19,600	千マレーシアリンギット 19,420	484,926	0.4	—	0.2	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 86,150	千南アフリカランド 81,610	726,332	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	120,868,880	100.4	—	52.4	33.8	14.2

(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 末			償還年月日
			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					
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,387	263,710	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	3,400	3,390	374,483	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,000	1,993	220,172	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	1,800	1,793	198,100	2018/4/15
	0.75 T-NOTE 180430	0.75	200	199	22,006	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180831	0.75	3,900	3,878	428,310	2018/8/31
	0.75 T-NOTE 180930	0.75	2,600	2,583	285,315	2018/9/30
	0.75 T-NOTE 181031	0.75	300	297	32,897	2018/10/31
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	700	693	76,604	2019/2/15
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	3,000	2,959	326,880	2019/7/15
	0.75 T-NOTE 190815	0.75	2,300	2,267	250,370	2019/8/15
	0.875 T-NOTE 180331	0.875	1,800	1,796	198,419	2018/3/31
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	1,400	1,396	154,229	2018/5/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	2,200	2,192	242,104	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,500	2,487	274,708	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190415	0.875	2,000	1,983	219,076	2019/4/15
	0.875 T-NOTE 190515	0.875	2,000	1,981	218,886	2019/5/15
	0.875 T-NOTE 190615	0.875	1,800	1,782	196,827	2019/6/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	900	890	98,312	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	3,400	3,357	370,816	2019/9/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	2,100	2,098	231,806	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	1,700	1,698	187,535	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	2,600	2,596	286,796	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	2,700	2,694	297,617	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	2,600	2,593	286,459	2018/9/15
	1 T-NOTE 181130	1.0	300	298	33,019	2018/11/30
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,400	1,393	153,861	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	1,100	1,092	120,606	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	600	594	65,676	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,782	196,858	2019/9/30
	1 T-NOTE 191015	1.0	1,700	1,682	185,833	2019/10/15
	1 T-NOTE 191115	1.0	2,500	2,472	273,090	2019/11/15
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,800	1,780	196,594	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,200	243,015	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	1,800	1,796	198,442	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190131	1.125	2,300	2,295	253,505	2019/1/31
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,593	176,020	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,700	1,684	186,068	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200331	1.125	1,300	1,284	141,889	2020/3/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	600	592	65,409	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	2,400	2,340	258,450	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,200	2,135	235,792	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,200	2,132	235,508	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	3,000	2,905	320,888	2021/8/31

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		
	%	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 210930	1.125	2,700	2,610	288,333	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	2,400	2,402	265,283	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	1,600	1,601	176,848	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,501	276,218	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	2,000	2,001	221,026	2018/12/15
	1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,850	1,850	204,401	2019/1/31
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	600	599	66,212	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	1,400	1,394	153,975	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	2,700	2,682	296,254	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,350	1,340	147,993	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,700	1,663	183,758	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	2,000	1,942	214,564	2021/10/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,300	1,229	135,798	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,800	1,805	199,436	2018/6/30
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,300	2,307	254,865	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	3,000	3,009	332,329	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,000	1,002	110,754	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,500	1,504	166,112	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,200	1,202	132,828	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,900	1,894	209,196	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200215	1.375	1,700	1,694	187,109	2020/2/15
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,500	2,490	275,021	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,100	2,090	230,909	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	2,000	1,988	219,654	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,700	1,688	186,530	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,650	2,625	289,922	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	2,600	2,572	284,160	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	4,600	4,548	502,308	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	2,300	2,266	250,320	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,400	2,358	260,479	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	3,200	3,141	346,947	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,200	2,098	231,806	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,700	2,570	283,860	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,300	2,187	241,589	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	3,400	3,415	377,256	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,800	2,813	310,754	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,600	2,612	288,512	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,400	2,411	266,319	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,004	110,936	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,800	2,811	310,500	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	2,000	2,004	221,328	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,904	320,738	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	2,000	1,994	220,258	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,400	2,352	259,775	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	1,900	1,835	202,704	2023/2/28

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		
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 230331	1.5	1,800	1,736	191,772	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,600	5,180	572,175	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	2,700	2,719	300,307	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,100	1,107	122,319	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,700	1,710	188,950	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,200	1,207	133,356	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,100	3,118	344,356	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,200	1,205	133,118	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	2,700	2,701	298,327	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	2,400	2,399	264,973	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	2,400	2,391	264,124	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,600	1,566	172,983	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,400	2,343	258,791	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	3,400	3,300	364,495	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	1,600	1,551	171,389	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	800	772	85,328	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,400	4,136	456,817	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	4,600	4,314	476,470	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	700	706	77,999	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,300	2,320	256,274	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,700	1,703	188,114	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	2,400	2,400	265,118	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,300	1,291	142,596	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,100	2,081	229,858	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,200	2,178	240,614	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,900	1,879	207,590	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,400	1,384	152,876	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	2,000	1,968	217,376	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,000	1,961	216,617	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,000	3,910	431,854	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,300	1,311	144,861	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,300	2,296	253,615	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220228	1.875	2,600	2,593	286,448	2022/2/28
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,000	1,989	219,758	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	2,000	1,982	218,999	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,000	1,979	218,619	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,100	1,113	122,955	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,617	178,678	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,313	145,007	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	1,700	1,714	189,361	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	2,200	2,216	244,742	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	2,300	2,311	255,331	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	2,500	2,510	277,286	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	3,400	3,415	377,168	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	2,200	2,208	243,917	2022/2/15

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		
	%	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 T-NOTE 220731	2.0	2,000	1,998	220,672	2022/7/31	
2 T-NOTE 221130	2.0	1,900	1,891	208,934	2022/11/30	
2 T-NOTE 230215	2.0	3,550	3,530	389,887	2023/2/15	
2 T-NOTE 250215	2.0	4,500	4,399	485,875	2025/2/15	
2 T-NOTE 250815	2.0	4,600	4,478	494,608	2025/8/15	
2 T-NOTE 261115	2.0	3,900	3,766	415,977	2026/11/15	
2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,200	2,234	246,783	2020/8/31	
2.125 T-NOTE 210131	2.125	1,600	1,621	179,064	2021/1/31	
2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,600	2,629	290,441	2021/6/30	
2.125 T-NOTE 210815	2.125	5,200	5,258	580,748	2021/8/15	
2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,525	278,925	2021/9/30	
2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,300	2,321	256,353	2021/12/31	
2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,800	1,811	200,065	2022/6/30	
2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,650	1,652	182,524	2022/12/31	
2.125 T-NOTE 231130	2.125	1,700	1,693	187,014	2023/11/30	
2.125 T-NOTE 250515	2.125	4,500	4,431	489,408	2025/5/15	
2.25 T-BOND 460815	2.25	3,000	2,549	281,544	2046/8/15	
2.25 T-NOTE 180731	2.25	300	304	33,630	2018/7/31	
2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,900	1,933	213,573	2021/3/31	
2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,200	2,238	247,219	2021/4/30	
2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,100	2,134	235,692	2021/7/31	
2.25 T-NOTE 231231	2.25	1,700	1,705	188,349	2023/12/31	
2.25 T-NOTE 240131	2.25	1,900	1,904	210,376	2024/1/31	
2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,500	4,488	495,737	2024/11/15	
2.25 T-NOTE 251115	2.25	4,800	4,758	525,514	2025/11/15	
2.25 T-NOTE 270215	2.25	1,500	1,480	163,485	2027/2/15	
2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,318	145,652	2018/5/31	
2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,015	112,174	2018/6/30	
2.375 T-NOTE 201231	2.375	800	818	90,415	2020/12/31	
2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,000	4,031	445,280	2024/8/15	
2.5 T-BOND 450215	2.5	2,900	2,614	288,798	2045/2/15	
2.5 T-BOND 460215	2.5	2,550	2,294	253,371	2046/2/15	
2.5 T-BOND 460515	2.5	2,850	2,562	283,008	2046/5/15	
2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,300	3,366	371,769	2023/8/15	
2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,750	4,834	533,975	2024/5/15	
2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,500	1,525	168,423	2018/4/30	
2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,300	2,374	262,287	2020/8/15	
2.625 T-NOTE 201115	2.625	3,800	3,922	433,180	2020/11/15	
2.75 T-BOND 420815	2.75	1,700	1,627	179,724	2042/8/15	
2.75 T-BOND 421115	2.75	3,000	2,867	316,669	2042/11/15	
2.75 T-NOTE 180228	2.75	900	914	100,945	2018/2/28	
2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,300	1,337	147,666	2019/2/15	
2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,900	5,071	560,138	2023/11/15	
2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,500	3,621	399,978	2024/2/15	
2.875 T-BOND 430515	2.875	2,850	2,784	307,499	2043/5/15	

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 450815	2.875	2,900	2,822	311,718	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	2,000	1,948	215,185	2046/11/15
		2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,000	1,018	112,437	2018/3/31
		3 T-BOND 420515	3.0	1,300	1,304	144,031	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	2,750	2,747	303,401	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	2,950	2,943	325,085	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	2,850	2,842	313,942	2045/11/15
		3 T-BOND 470215	3.0	800	800	88,358	2047/2/15
		3.125 T-BOND 411115	3.125	1,050	1,078	119,141	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	1,400	1,437	158,795	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	1,900	1,945	214,819	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	3,200	3,273	361,470	2044/8/15
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,700	2,804	309,707	2019/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,400	2,526	279,054	2021/5/15
		3.375 T-BOND 440515	3.375	3,200	3,426	378,422	2044/5/15
		3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,000	3,152	348,157	2019/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,104	121,958	2039/2/15
		3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,300	2,437	269,173	2020/5/15
		3.625 T-BOND 430815	3.625	2,450	2,737	302,286	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	3,150	3,521	388,952	2044/2/15
		3.625 T-NOTE 190815	3.625	2,200	2,317	255,961	2019/8/15
		3.625 T-NOTE 200215	3.625	2,900	3,075	339,692	2020/2/15
		3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,300	3,534	390,305	2021/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	1,100	1,251	138,226	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	3,050	3,482	384,631	2043/11/15
		3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,700	2,812	310,604	2018/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	1,200	1,392	153,742	2040/8/15
		3.875 T-NOTE 180515	3.875	500	515	56,949	2018/5/15
		4 T-NOTE 180815	4.0	900	935	103,367	2018/8/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	600	735	81,178	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	1,250	1,530	169,057	2040/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	400	501	55,344	2038/2/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	750	934	103,181	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,500	1,869	206,453	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,100	1,374	151,807	2041/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	1,000	1,272	140,500	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	500	636	70,301	2038/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	650	823	90,927	2039/8/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	1,500	1,933	213,546	2040/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,400	1,839	203,163	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	400	539	59,613	2037/5/15	
	5.25 T-BOND 281115	5.25	650	830	91,762	2028/11/15	
	5.25 T-BOND 290215	5.25	400	512	56,652	2029/2/15	
	5.375 T-BOND 310215	5.375	900	1,202	132,755	2031/2/15	
	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	779	86,044	2028/8/15	

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	6 T-BOND 260215	6.0	700	905	99,950	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	600	807	89,130	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	600	748	82,628	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	500	708	78,209	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	500	677	74,771	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	800	1,016	112,289	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	695	76,770	2019/8/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	864	95,439	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,144	126,440	2019/2/15
小 計					53,853,465	
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	1,095	90,671	2018/5/1
	0.5 CAN GOVT 180801	0.5	800	798	66,071	2018/8/1
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	1,200	1,195	99,000	2018/11/1
	0.5 CAN GOVT 190201	0.5	400	398	32,964	2019/2/1
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,200	1,164	96,395	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,100	1,092	90,428	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,300	1,287	106,537	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	1,000	986	81,659	2021/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	400	372	30,827	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	700	703	58,276	2018/3/1
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	1,200	1,209	100,135	2018/9/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	700	712	58,972	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,000	1,010	83,647	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	900	889	73,641	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	917	75,935	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,100	1,125	93,134	2019/9/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,000	1,054	87,312	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	950	1,018	84,340	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	850	917	75,930	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	850	934	77,335	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	250	283	23,501	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	872	72,200	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,200	1,297	107,400	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,150	1,424	117,944	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,400	1,489	123,340	2019/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,100	1,436	118,883	2041/6/1
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,000	1,042	86,265	2018/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	950	1,367	113,171	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	800	1,131	93,642	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	900	1,343	111,226	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	250	395	32,731	2027/6/1
小 計					2,563,524	
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	18,200	21,412	125,904	2024/12/5

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		
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 361120	10.0	4,700	5,966	35,082	2036/11/20	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	12,200	11,948	70,256	2018/6/14	
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	17,900	17,155	100,875	2019/12/11	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	6,900	6,307	37,087	2026/3/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	21,900	21,626	127,163	2021/6/10	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	10,000	9,825	57,773	2022/6/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,900	8,130	47,806	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,800	10,206	60,011	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	6,500	6,750	39,695	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	12,300	12,788	75,195	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	10,900	11,257	66,195	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	6,100	6,444	37,892	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	17,300	17,801	104,669	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,600	7,303	42,942	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	7,100	7,940	46,687	2038/11/18	
小 計					1,075,239		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,500	1,454	174,187	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,000	1,019	122,063	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	1,700	1,732	207,526	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	1,000	1,018	122,022	2021/10/8
		0 SCHATS 180316	—	900	907	108,638	2018/3/16
		0 SCHATS 180615	—	1,200	1,211	145,106	2018/6/15
		0 SCHATS 181214	—	200	202	24,272	2018/12/14
		0.25 BUND 270215	0.25	350	344	41,300	2027/2/15
		0.25 OBL 180413	0.25	1,400	1,415	169,523	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	1,700	1,741	208,576	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,450	1,492	178,683	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	1,900	1,962	235,084	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,100	2,149	257,394	2026/2/15
		0.5 OBL 190412	0.5	1,400	1,435	171,963	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,150	1,234	147,877	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,900	2,034	243,710	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,233	147,691	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,447	173,349	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,426	170,847	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,200	1,321	158,263	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,600	1,765	211,413	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,050	1,165	139,530	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,700	1,885	225,819	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,150	1,294	155,046	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,400	1,560	186,918	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,500	1,706	204,421	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,200	1,318	157,883	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,232	147,592	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	1,784	213,740	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,350	1,787	214,122	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,400	1,871	224,132	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,500	1,678	201,072	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,300	1,443	172,864	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,350	1,565	187,531	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,100	1,634	195,767	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,800	1,974	236,448	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,900	2,054	246,016	2019/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,600	2,506	300,217	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,600	1,703	203,997	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	920	1,528	183,060	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	800	1,177	141,017	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,400	2,305	276,145	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,250	2,231	267,249	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,200	1,979	237,108	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,150	1,782	213,485	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	600	858	102,808	2024/1/4
6.25 BUND 300104	6.25	550	939	112,561	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	800	1,294	155,041	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 191015	0.05	200	198	23,795	2019/10/15
		0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	900	900	107,819	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	200	200	24,066	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	500	502	60,227	2018/10/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	390	46,781	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,100	1,089	130,503	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	900	905	108,432	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	500	472	56,540	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,000	1,009	120,908	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,300	1,268	151,971	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	900	917	109,879	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,100	1,008	120,720	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,150	1,161	139,117	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,200	1,212	145,160	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,050	1,080	129,394	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,350	1,300	155,711	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,400	1,331	159,480	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,300	1,149	137,673	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,287	154,168	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	700	738	88,494	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	300	294	35,311	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	900	816	97,778	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	400	383	45,895	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,300	1,363	163,322	2019/5/1
2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,400	1,455	174,286	2024/12/1		

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	2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,000	886	106,193	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	400	331	39,651	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,050	1,039	124,479	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,700	1,773	212,392	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,400	1,481	177,478	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,300	1,423	170,419	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,000	2,245	268,864	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,900	2,134	255,683	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,600	2,927	350,609	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,400	1,579	189,154	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,400	1,567	187,671	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,850	2,111	252,831	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,477	296,678	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,100	2,301	275,571	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,800	2,004	240,003	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,100	2,230	267,068	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,000	2,169	259,825	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,700	1,899	227,492	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,600	1,881	225,379	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,550	1,826	218,699	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,500	1,775	212,648	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,000	2,337	279,916	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,100	2,510	300,640	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,400	1,703	204,031	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,100	1,367	163,791	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,400	1,658	198,680	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,750	2,132	255,413	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,750	2,237	267,937	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,400	1,792	214,677	2039/8/1
5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,600	2,036	243,839	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,100	2,689	322,075	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,400	1,708	204,625	2022/9/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,200	1,467	175,691	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,200	1,644	196,977	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,250	3,116	373,210	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,800	2,482	297,256	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	700	1,001	119,899	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,000	1,461	175,040	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O.A.T 190225	—	700	706	84,628	2019/2/25
		0 O.A.T 200225	—	200	201	24,161	2020/2/25
		0 O.A.T 200525	—	1,600	1,615	193,459	2020/5/25
		0 O.A.T 210525	—	1,600	1,607	192,471	2021/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	1,600	1,627	194,896	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	1,200	1,118	133,975	2026/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	2,100	2,149	257,435	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	2,800	2,751	329,548	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	2,100	2,025	242,593	2026/5/25
		1 O.A.T 180525	1.0	1,700	1,731	207,309	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	1,700	1,742	208,687	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	1,700	1,753	209,974	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	1,900	1,931	231,324	2025/11/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	1,000	935	112,052	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	2,050	2,087	249,955	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	2,500	2,717	325,462	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,150	2,332	279,399	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	400	401	48,071	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	400	348	41,728	2066/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	2,200	2,450	293,441	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	1,800	2,020	241,995	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	2,500	2,745	328,746	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	2,150	2,468	295,609	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	2,400	2,799	335,245	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,100	3,557	425,990	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	2,800	3,220	385,735	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,850	2,366	283,452	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,700	3,017	361,422	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,800	3,447	412,916	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	2,600	2,881	345,046	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,100	3,594	430,426	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	2,200	2,308	276,478	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,900	2,693	322,610	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,090	1,632	195,474	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	800	1,218	145,896	2060/4/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	1,900	2,044	244,790	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	2,250	2,471	296,017	2019/4/25
4.25 O.A.T 231025	4.25	3,200	4,002	479,302	2023/10/25		
4.5 O.A.T 410425	4.5	2,150	3,283	393,183	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	2,050	3,092	370,358	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	2,300	3,425	410,201	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	2,000	3,222	385,914	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	1,900	2,734	327,522	2025/10/25		
8.5 O.A.T 191025	8.5	900	1,108	132,696	2019/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	1,000	1,495	179,093	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	900	907	108,650	2018/4/15
		0 NETH GOVT 220115	—	300	303	36,316	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	1,000	1,024	122,674	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,000	991	118,751	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,100	1,101	131,952	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	300	303	36,304	2027/7/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,100	1,138	136,357	2019/1/15

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	1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,110	133,025	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,100	1,247	149,402	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,000	1,129	135,327	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	900	1,117	133,841	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	850	1,170	140,231	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,800	2,083	249,495	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	700	794	95,101	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	490	58,721	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,050	1,650	197,622	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,000	1,062	127,205	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,100	1,218	145,920	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,050	1,621	194,145	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,100	1,666	199,520	2028/1/15
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	700	1,010	121,036	2023/1/15
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,400	1,408	168,684	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	600	604	72,438	2019/1/31
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	150	149	17,847	2022/4/30
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,300	1,327	158,964	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,100	1,141	136,706	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,300	1,267	151,831	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,600	1,668	199,845	2020/1/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	850	835	100,007	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,600	1,629	195,206	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,400	1,446	173,179	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,400	1,380	165,363	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,600	1,685	201,851	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,600	1,699	203,501	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,700	1,885	225,781	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	600	598	71,661	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	300	315	37,840	2066/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,500	1,598	191,442	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,200	1,420	170,163	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,600	1,798	215,380	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,500	1,588	190,227	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,300	1,634	195,782	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,800	2,006	240,285	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,500	1,830	219,178	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,500	1,667	199,680	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,650	2,067	247,647	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,100	1,484	177,797	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,200	1,499	179,583	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,550	1,816	217,492	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,150	1,585	189,885	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	700	940	112,652	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	850	1,217	145,790	2044/10/31

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	5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,600	2,026	242,635	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,700	2,069	247,837	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,400	2,048	245,281	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,700	2,142	256,571	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,000	1,374	164,652	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,800	2,588	310,002	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,300	1,324	158,656	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	400	396	47,538	2027/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	900	922	110,482	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	700	679	81,402	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	700	716	85,785	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	450	424	50,831	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	150	159	19,117	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	200	199	23,879	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,150	1,304	156,191	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	200	209	25,039	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,200	1,393	166,861	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,000	1,088	130,357	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	350	441	52,861	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,400	1,605	192,245	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	700	1,010	121,072	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	800	837	100,275	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	900	983	117,771	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,000	1,208	144,710	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	700	969	116,160	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,150	1,385	165,868	2021/9/28
4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,100	1,360	162,979	2022/9/28		
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,250	1,912	229,031	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	700	938	112,432	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	1,450	2,310	276,725	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,400	2,088	250,062	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	100	99	11,929	2023/7/15
		0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	500	510	61,172	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	750	760	91,098	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	500	514	61,588	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,000	1,066	127,683	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	200	199	23,943	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	552	66,121	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	850	943	113,027	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	500	528	63,300	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	400	484	58,019	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	500	696	83,422	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	700	837	100,251	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,050	1,227	146,982	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	715	85,702	2022/4/20

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	3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	250	421	50,484	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,000	1,145	137,136	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	850	1,294	155,030	2037/3/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	800	878	105,219	2019/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	750	1,042	124,847	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	500	785	94,081	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	150	150	18,065	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	200	198	23,724	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	410	49,198	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	399	47,875	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	300	295	35,363	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	100	103	12,417	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	205	24,603	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	435	52,178	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	400	436	52,302	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	300	337	40,467	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	460	55,170	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	368	44,105	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	559	66,977	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	400	462	55,382	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	600	779	93,397	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	550	612	73,334	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	400	413	49,559	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	398	47,693	2026/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	300	290	34,825	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	438	52,570	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	600	664	79,562	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	500	596	71,418	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	484	58,046	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	500	553	66,230	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	650	700	83,836	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	800	915	109,601	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	600	710	85,110	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	900	1,217	145,810	2025/3/13
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	500	579	69,433	2019/10/18		
小 計						47,797,690	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	200	198	27,469	2022/7/22	
	1.25 GILT 180722	1.25	2,400	2,435	336,677	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,850	1,929	266,782	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	1,400	1,446	199,997	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	100	93	12,969	2047/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,177	301,019	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,100	2,231	308,442	2022/9/7	
	1.75 GILT 370907	1.75	300	298	41,215	2037/9/7	

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	1.75 GILT 570722	1.75	300	308	42,690	2057/7/22
	2 GILT 200722	2.0	1,800	1,901	262,927	2020/7/22
	2 GILT 250907	2.0	1,600	1,732	239,477	2025/9/7
	2.25 GILT 230907	2.25	1,500	1,645	227,426	2023/9/7
	2.5 GILT 650722	2.5	810	1,045	144,474	2065/7/22
	2.75 GILT 240907	2.75	1,500	1,705	235,748	2024/9/7
	3.25 GILT 440122	3.25	1,680	2,184	302,056	2044/1/22
	3.5 GILT 450122	3.5	1,650	2,252	311,371	2045/1/22
	3.5 GILT 680722	3.5	1,500	2,475	342,173	2068/7/22
	3.75 GILT 190907	3.75	1,000	1,087	150,354	2019/9/7
	3.75 GILT 200907	3.75	1,200	1,344	185,847	2020/9/7
	3.75 GILT 210907	3.75	1,200	1,377	190,475	2021/9/7
	3.75 GILT 520722	3.75	1,370	2,114	292,323	2052/7/22
	4 GILT 220307	4.0	1,050	1,231	170,318	2022/3/7
	4 GILT 600122	4.0	800	1,383	191,272	2060/1/22
	4.25 GILT 271207	4.25	850	1,110	153,493	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	1,200	1,637	226,353	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	1,685	2,378	328,772	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	970	1,410	195,013	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	1,200	1,766	244,155	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,250	1,955	270,326	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	1,130	1,835	253,792	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	1,250	2,172	300,322	2055/12/7
	4.5 GILT 190307	4.5	1,300	1,410	194,954	2019/3/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,400	2,003	276,930	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,200	1,865	257,924	2042/12/7
	4.75 GILT 200307	4.75	1,400	1,587	219,433	2020/3/7
	4.75 GILT 301207	4.75	950	1,342	185,531	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	1,220	1,878	259,728	2038/12/7
	5 GILT 180307	5.0	1,100	1,150	159,066	2018/3/7
	5 GILT 250307	5.0	850	1,118	154,672	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	750	1,135	157,018	2028/12/7
	8 GILT 210607	8.0	900	1,188	164,317	2021/6/7
小計					8,785,320	
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	299	33,507	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	310	340	38,115	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	400	433	48,445	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	280	354	39,588	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	410	591	66,107	2028/4/8
小計					225,764	
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	4,429	55,678	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,450	5,893	74,087	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,900	5,701	71,662	2025/5/12

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	
スウェーデン			%	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	千円	
国債証券	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,850	8,082	101,600	2022/6/1	
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,150	4,238	53,276	2039/3/30	
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	6,800	7,445	93,593	2019/3/12	
	5 SWD GOVT 201201	5.0	6,600	7,879	99,040	2020/12/1	
小 計					548,939		
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	2,600	2,577	33,613	2026/2/19	
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,700	2,756	35,938	2025/3/13	
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,200	4,392	57,272	2023/5/24	
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,150	3,494	45,567	2024/3/14	
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	5,600	6,235	81,310	2021/5/25	
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,500	5,955	77,658	2019/5/22	
小 計					331,360		
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	3,400	3,447	55,504	2018/11/15	
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,300	3,603	58,010	2023/11/15	
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,300	8,150	131,222	2025/11/15	
	3 DMK GOVT 211115	3.0	6,400	7,346	118,271	2021/11/15	
	4 DMK GOVT 191115	4.0	6,200	6,924	111,488	2019/11/15	
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	8,900	14,928	240,356	2039/11/15	
小 計					714,854		
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	1,900	1,852	51,999	2020/4/25	
	1.75 POLAND 210725	1.75	2,200	2,111	59,271	2021/7/25	
	2 POLAND 210425	2.0	2,000	1,947	54,674	2021/4/25	
	2.25 POLAND 220425	2.25	400	387	10,873	2022/4/25	
	2.5 POLAND 180725	2.5	1,900	1,921	53,930	2018/7/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	2,500	2,316	65,034	2026/7/25	
	2.5 POLAND 270725	2.5	1,200	1,097	30,804	2027/7/25	
	3.25 POLAND 190725	3.25	2,000	2,051	57,577	2019/7/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,000	1,988	55,816	2025/7/25	
	3.75 POLAND 180425	3.75	1,100	1,126	31,624	2018/4/25	
	4 POLAND 231025	4.0	2,250	2,367	66,451	2023/10/25	
	5.25 POLAND 201025	5.25	1,300	1,421	39,902	2020/10/25	
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,300	1,409	39,552	2019/10/25	
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,300	1,465	41,129	2021/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,650	1,879	52,748	2022/9/23	
	5.75 POLAND 290425	5.75	600	729	20,471	2029/4/25	
POLAND 181025	—	2,200	2,136	59,969	2018/10/25		
小 計					791,830		
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	1,335	112,540	2020/11/21	
	2 AUST GOVT 211221	2.0	450	445	37,553	2021/12/21	
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	950	895	75,471	2028/5/21	
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,600	1,635	137,870	2019/10/21	

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	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
国債証券	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,750	1,774	149,593	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,350	1,341	113,097	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	400	368	31,088	2035/6/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	550	479	40,386	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	1,100	1,126	94,969	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,000	2,089	176,140	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,050	1,085	91,492	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	300	288	24,347	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	700	736	62,033	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,200	2,473	208,482	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,000	2,150	181,272	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	800	934	78,800	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,900	2,231	188,095	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,700	1,814	152,915	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,550	1,821	153,534	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,150	2,457	207,138	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,800	2,110	177,833	2022/7/15
小 計					2,494,658	
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	497	39,365	2018/4/1
	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	350	352	27,923	2019/10/1
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	150	152	12,083	2020/7/1
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	100	99	7,899	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	615	48,652	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	300	306	24,219	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	500	513	40,652	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	400	419	33,169	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	340	358	28,363	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	150	158	12,518	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	105	8,361	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	300	316	25,048	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	350	372	29,488	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	350	373	29,554	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	400	423	33,526	2020/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	180	202	16,041	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	380	421	33,374	2027/3/1
	4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	300	312	24,729	2018/9/1
小 計					474,972	
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	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	879	21,958	2022/8/15
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,166	29,137	2023/3/15
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	700	697	17,407	2020/3/31
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	280	7,013	2027/5/31
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	200	200	5,009	2018/9/28
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	1,100	1,101	27,516	2019/10/31

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		
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	3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	999	24,960	2020/10/15
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	600	562	14,045	2028/6/15
	3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	600	603	15,077	2019/3/15
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	900	892	22,296	2022/9/30
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	200	198	4,944	2023/8/17
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	600	552	13,783	2033/4/15
	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	700	704	17,600	2020/7/31
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	481	12,011	2027/3/15
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	100	98	2,461	2026/11/30
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	1,150	1,131	28,244	2025/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	908	22,675	2021/9/30
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	600	567	14,166	2032/4/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,050	1,065	26,603	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,000	1,001	25,015	2024/7/15
	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	800	778	19,448	2031/6/30
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	350	333	8,321	2035/5/31
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,200	1,222	30,518	2019/11/29
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,010	25,238	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	900	901	22,517	2030/4/15
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	200	198	4,951	2046/3/15
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	353	8,825	2043/9/30
	5.248 MALAYSIA 280915	5.248	200	213	5,336	2028/9/15
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	300	313	7,837	2019/7/30
小 計					484,926	
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	12,500	14,262	126,936	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	6,550	4,893	43,549	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	6,600	4,913	43,731	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,700	3,596	32,010	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	7,200	6,182	55,028	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	3,800	3,785	33,689	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	4,400	4,364	38,846	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	3,000	3,029	26,962	2018/12/21
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	6,500	6,133	54,584	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,300	5,019	44,669	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	6,900	6,492	57,786	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,500	5,250	46,733	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	9,200	8,773	78,086	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	2,700	2,649	23,583	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	2,300	2,262	20,134	2040/1/31
小 計					726,332	
合 計					120,868,880	

(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

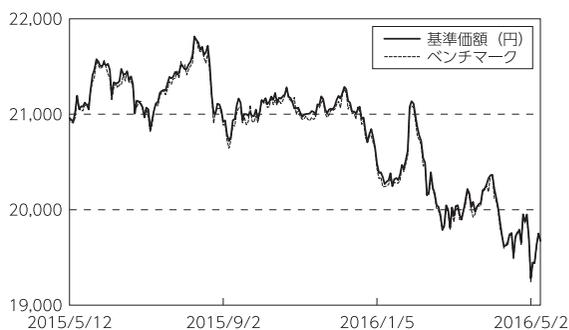
◎基準価額の動き

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。

- ・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。

○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 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		
		%	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 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	利 率	当 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	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					
	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	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					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
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					
		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	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 SINGAPORGOVT 180401	0.5	600	594	47,129	2018/4/1
	1.375 SINGAPORGOV 171001	1.375	100	100	7,985	2017/10/1
	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	150	152	12,057	2019/10/1
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	250	256	20,343	2020/7/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	618	49,091	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	150	154	12,283	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	600	624	49,498	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	400	422	33,516	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	450	475	37,723	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	150	157	12,462	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 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	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	400	425	33,779	2030/9/1
		3.SINGAPORGOVT 240901	3.0	600	646	51,259	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	470	508	40,306	2022/9/1
		3.25.SINGAPORGOVT 200901	3.25	400	430	34,157	2020/9/1
		3.375.SINGAPORGOVT 330901	3.375	200	227	18,050	2033/9/1
		3.5.SINGAPORGOVT 270301	3.5	470	531	42,177	2027/3/1
		4.SINGAPORGOVT 180901	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.MALAYSIAGOV 180301	3.26	900	903	24,360	2018/3/1
		3.314.MALAYSIA 171031	3.314	1,100	1,105	29,819	2017/10/31
		3.418.MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	879	23,730	2022/8/15
		3.48.MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,173	31,654	2023/3/15
		3.492.MALAYSIAGOV 200331	3.492	900	899	24,256	2020/3/31
		3.502.MALAYSIAGOV 270531	3.502	800	750	20,252	2027/5/31
		3.58.MALAYSIAGOV 180928	3.58	800	806	21,742	2018/9/28
		3.654.MALAYSIAGOV 191031	3.654	700	705	19,027	2019/10/31
		3.659.MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	1,007	27,185	2020/10/15
		3.733.MALAYSIAGO 280615	3.733	600	572	15,435	2028/6/15
		3.759.MALAYSIAGOV 190315	3.759	450	456	12,311	2019/3/15
		3.795.MALAYSIAGOV 220930	3.795	900	898	24,244	2022/9/30
		3.8.MALAYSIAGOV 230817	3.8	200	200	5,400	2023/8/17
		3.844.MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	281	7,590	2033/4/15
		3.889.MALAYSIAGO 200731	3.889	700	710	19,154	2020/7/31
		3.892.MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	488	13,177	2027/3/15
		3.955.MALAYSIAGOV 250915	3.955	1,150	1,154	31,131	2025/9/15
		4.012.MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,500	1,520	40,997	2017/9/15
		4.048.MALAYSIA 210930	4.048	900	915	24,688	2021/9/30
		4.127.MALAYSIA 320415	4.127	700	682	18,399	2032/4/15
		4.16.MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,200	1,228	33,138	2021/7/15
		4.181.MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,400	1,423	38,381	2024/7/15
		4.232.MALAYSIAGOV 310630	4.232	300	301	8,128	2031/6/30
		4.24.MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,200	1,224	33,022	2018/2/7
		4.254.MALAYSIAGOV 350531	4.254	350	347	9,376	2035/5/31
		4.378.MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,900	1,960	52,866	2019/11/29
		4.392.MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,026	27,696	2026/4/15
		4.498.MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,200	1,229	33,155	2030/4/15
		4.935.MALAYSIAGOV 430930	4.935	600	619	16,699	2043/9/30
		5.248.MALAYSIA 280915	5.248	200	219	5,909	2028/9/15
		5.734.MALAYSIAGOV 190730	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.SOUTH AFRICA 261221	10.5	15,000	16,338	117,800	2026/12/21
		6.25.SOUTH AFRICA 360331	6.25	7,350	5,129	36,980	2036/3/31
		6.5.SOUTH AFRICA 410228	6.5	7,200	4,977	35,889	2041/2/28
		6.75.SOUTH AFRICA 210331	6.75	5,700	5,267	37,981	2021/3/31
		7.SOUTH AFRICA 310228	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 AFRIC 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)