

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、FTSE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	FTSE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。	
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） </div>	

※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12期（決算日：2019年3月25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25日に第12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
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取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)	額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額	
		税 分	達 配	み 金	期 騰	中 落				期 騰
	円	円	円	騰	落	騰	落	騰	落	
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
11期(2018年3月26日)	11,888		0		2.5	110,638.37	3.4	98.6	—	3,778
12期(2019年3月25日)	12,228		0		2.9	114,357.12	3.4	98.8	—	1,713

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、FTSE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		F T S E 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) 2018年3月26日	円 11,888	% —	110,638.37	% —	% 98.6	% —
3月末	12,032	1.2	112,110.56	1.3	98.4	—
4月末	12,175	2.4	113,447.49	2.5	98.7	—
5月末	11,851	△0.3	110,306.34	△0.3	98.8	—
6月末	12,023	1.1	112,167.37	1.4	98.8	—
7月末	12,110	1.9	113,026.89	2.2	98.7	—
8月末	12,098	1.8	112,887.86	2.0	99.2	—
9月末	12,297	3.4	115,005.76	3.9	99.0	—
10月末	12,070	1.5	112,853.40	2.0	98.5	—
11月末	12,176	2.4	113,725.26	2.8	98.6	—
12月末	12,096	1.7	112,822.19	2.0	98.7	—
2019年1月末	12,016	1.1	111,997.50	1.2	98.5	—
2月末	12,182	2.5	113,937.65	3.0	98.7	—
(期 末) 2019年3月25日	12,228	2.9	114,357.12	3.4	98.8	—

(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。

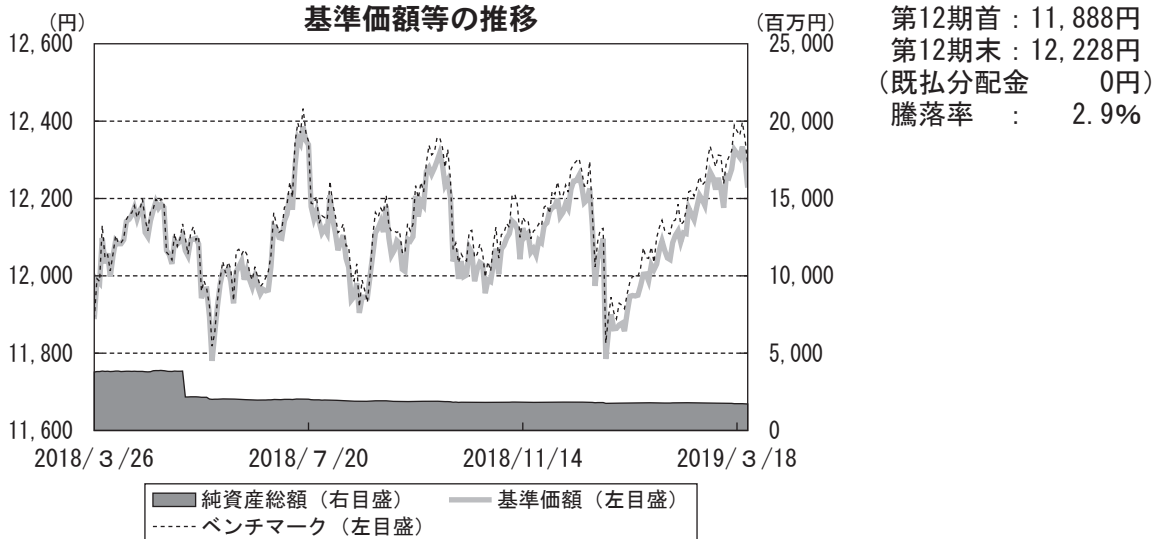
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第12期：2018/3/27～2019/3/25）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ2.9%の上昇となりました。
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（3.4%）を0.5%下回りました。



・分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。



実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

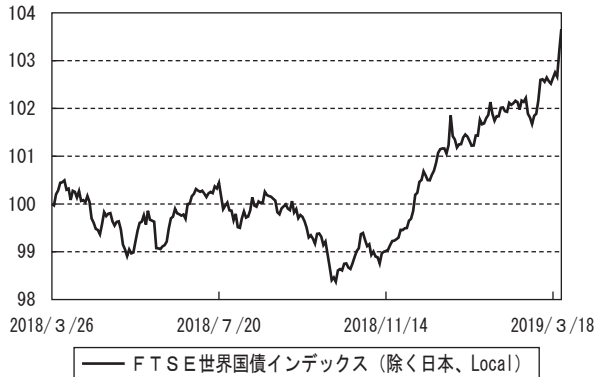
基準価額の主な変動要因

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> 先進国の債券市況が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。 米国の堅調な景気認識や利上げなどから、米ドルが対円で買われたことが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> 期の後半にかけて世界景気の減速懸念が高まったことなどから、ユーロが対円で売られたことが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

（第12期：2018/3/27～2019/3/25）

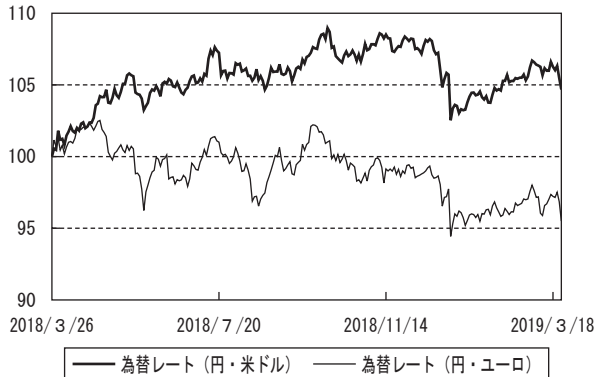
債券市況の推移 （期首を100として指数化）



◎債券市況

- ・先進国の債券市況は、期の後半にかけての米国の利上げ休止観測などが上昇要因となり、期首との比較では上昇しました。

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、米国の堅調な景気認識や利上げなどから、期首との比較では、米ドルは対円で上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、期の後半にかけて世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首との比較では、ユーロは対円で下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

i 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

<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FTSE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3.3%の上昇となりました。

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

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2018年3月26日）

期末（2019年3月25日）

最終利回り	1.7%	➡	最終利回り	1.6%
直接利回り	2.4%		直接利回り	2.4%
デュレーション	7.1年		デュレーション	7.2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

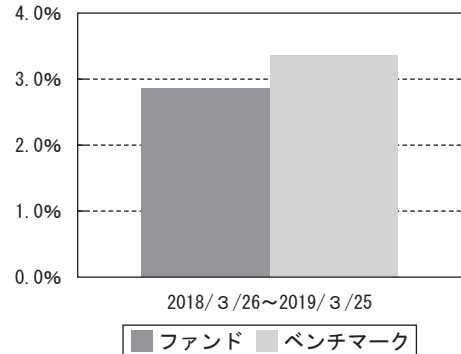
i ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。

＜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 $\Delta 0.5\%$ 程度となりました。

◎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による影響は $\Delta 0.4\%$ 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 $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



＜外国債券インデックスマザーファンド＞

ベンチマークは 3.4% の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・ありません。

（主なマイナス要因）

- ・評価時価差異要因※

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

分配金について

i 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額（翌期に繰越す分配原資）がどの程度あるかを確認できます。

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額的水準等を勘案し、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12期
	2018年3月27日～2019年3月25日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,132

(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 (作成対象期間末での見解です。)

<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

(2018年3月27日～2019年3月25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)	(33)	(0.270)	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)	(7)	(0.054)	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)	(5)	(0.040)	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	0.015	(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)	(1)	(0.011)	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	0.379	
期中の平均基準価額は、12,094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

(2018年3月27日～2019年3月25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 63,966	千円 129,152	千口 1,132,367	千円 2,286,486

○利害関係人との取引状況等

(2018年3月27日～2019年3月25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			売付額等 C		
		うち利害関係人 との取引状況B	B A		うち利害関係人 との取引状況D	D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	28,670	2,295	8.0	13,071	988	7.6

平均保有割合 1.7%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2019年3月25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	千口		千口	千円
	1,904,729		836,327	1,713,552

○投資信託財産の構成

(2019年3月25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	%
	1,713,552	99.4
コール・ローン等、その他	10,153	0.6
投資信託財産総額	1,723,705	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（138,335,400千円）の投資信託財産総額（138,454,424千円）に対する比率は99.9%です。

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

1アメリカドル=109.91円	1カナダドル=81.80円	1メキシコペソ=5.75円	1ユーロ=124.09円
1イギリスポンド=144.98円	1スウェーデンクローネ=11.84円	1ノルウェークローネ=12.83円	1デンマーククローネ=16.63円
1ポーランドズロチ=28.86円	1オーストラリアドル=77.73円	1シンガポールドル=81.25円	1マレーシアリングギット=27.02円
1南アフリカランド=7.57円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2019年3月25日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,723,705,936
コール・ローン等	3,360,670
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,713,552,127
未収入金	6,793,139
(B) 負債	9,879,335
未払解約金	6,674,328
未払信託報酬	3,170,477
未払利息	5
その他未払費用	34,525
(C) 純資産総額(A-B)	1,713,826,601
元本	1,401,573,120
次期繰越損益金	312,253,481
(D) 受益権総口数	1,401,573,120口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,228円

<注記事項>

- ①期首元本額 3,178,118,112円
 期中追加設定元本額 149,912,394円
 期中一部解約元本額 1,926,457,386円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,228円です。

○損益の状況（2018年3月27日～2019年3月25日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,297
受取利息	2
支払利息	△ 1,299
(B) 有価証券売買損益	53,421,082
売買益	86,327,519
売買損	△ 32,906,437
(C) 信託報酬等	△ 7,893,356
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	45,526,429
(E) 前期繰越損益金	△ 61,074,428
(F) 追加信託差損益金	327,801,480
(配当等相当額)	(520,393,856)
(売買損益相当額)	(△192,592,376)
(G) 計(D+E+F)	312,253,481
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	312,253,481
追加信託差損益金	327,801,480
(配当等相当額)	(520,642,794)
(売買損益相当額)	(△192,841,314)
分配準備積立金	58,496,446
繰越損益金	△ 74,044,445

- (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	2018年3月27日～ 2019年3月25日
費用控除後の配当等収益額	34,188,466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	520,642,794円
分配準備積立金額	24,307,980円
当ファンドの分配対象収益額	579,139,240円
1万口当たり収益分配対象額	4,132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 (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①信託報酬率の引き下げを行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2018年6月26日)
- ②使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2018年6月26日)
- ③2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

外国債券インデックスマザーファンド

《第17期》決算日2018年5月14日

[計算期間：2017年5月13日～2018年5月14日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月14日に第17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17期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	FTSE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FTSE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	FTSE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		FTSE世界国債インデックス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(除く日本、円換算ベース)	期 騰 落			
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2017年5月12日)	19,894	1.1	111,054.04	1.0	98.8	—	132,430
17期(2018年5月14日)	20,178	1.4	112,563.85	1.4	98.9	—	120,314

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、FTSE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		FTSE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
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2017年5月12日	円	%		%	%	%
	19,894	—	111,054.04	—	98.8	—
5月末	19,821	△0.4	110,685.94	△0.3	97.9	—
6月末	20,195	1.5	112,709.17	1.5	98.7	—
7月末	20,185	1.5	112,671.90	1.5	98.6	—
8月末	20,473	2.9	114,354.58	3.0	98.6	—
9月末	20,703	4.1	115,558.22	4.1	98.8	—
10月末	20,705	4.1	115,508.10	4.0	98.7	—
11月末	20,722	4.2	115,672.53	4.2	98.7	—
12月末	20,982	5.5	117,078.37	5.4	98.3	—
2018年1月末	20,465	2.9	114,201.85	2.8	98.4	—
2月末	19,940	0.2	111,369.59	0.3	98.6	—
3月末	20,074	0.9	112,110.56	1.0	98.4	—
4月末	20,318	2.1	113,447.49	2.2	98.7	—
(期 末) 2018年5月14日	20,178	1.4	112,563.85	1.4	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

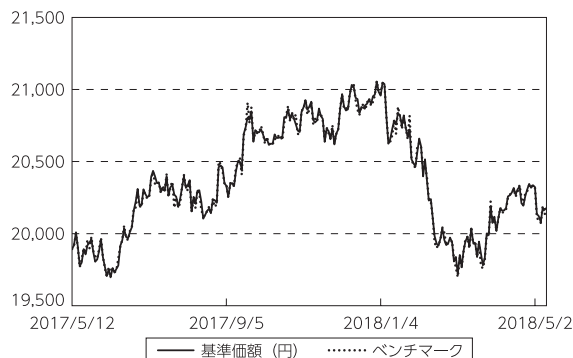
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.4%の上昇となりました。

◎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(1.4%)を0.0%上回りました。

基準価額等の推移



(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、利金が相応に積みあがったことなどから上昇しました。

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、期の後半にかけて欧米長期金利の上昇を嫌気したリスク回避姿勢の高まりなどから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4.1%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、欧州中央銀行（ECB）が金融緩和政策を縮小することが意識されたことや欧州経済の回復期待などを背景にユーロが対円で買われました。期首との比較では、ユーロは対円で5.6%上昇しました。

●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FTSE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1.4%の上昇となったため、乖離は0.0%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	0.0%程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・コストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年5月13日～2018年5月14日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.015	(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)	(0.015)	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
（ 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	0.015	
期中の平均基準価額は、20,381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。

○売買及び取引の状況

(2017年5月13日～2018年5月14日)

公社債

		買付額	売付額
外 国	アメリカ	千アメリカドル 169,469	千アメリカドル 199,248
	カナダ	千カナダドル 10,097	千カナダドル 12,048
	メキシコ	千メキシコペソ 33,224	千メキシコペソ 56,861
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 17,345	26,957
	イタリア	国債証券 22,631	33,201
	フランス	国債証券 23,800	32,812
	オランダ	国債証券 4,293	7,284
	スペイン	国債証券 14,479	18,035
	ベルギー	国債証券 4,777	7,683
	オーストリア	国債証券 3,016	4,352
	フィンランド	国債証券 598	1,251
	アイルランド	国債証券 2,279	2,849
	イギリス	国債証券 10,819	千イギリスポンド 18,544
	スイス	国債証券 25	千スイスフラン 281
	スウェーデン	国債証券 6,204	千スウェーデンクローネ 14,794
	ノルウェー	国債証券 3,988	千ノルウェークローネ 4,665
	デンマーク	国債証券 6,053	千デンマーククローネ 12,806
	ポーランド	国債証券 5,643	千ポーランドズロチ 9,930
	オーストラリア	国債証券 6,591	千オーストラリアドル 8,436
	シンガポール	国債証券 1,188	千シンガポールドル 1,248
	マレーシア	国債証券 2,679	千マレーシアリングgit 3,672
	南アフリカ	国債証券 16,216	千南アフリカランド 16,111

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2017年5月13日～2018年5月14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 19,212	百万円 570	% 3.0	百万円 33,008	百万円 2,719	% 8.2

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UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2018年5月14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	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
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	477,120	467,506	51,103,150	42.5	—	17.7	16.9	7.9
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	28,300	29,681	2,539,248	2.1	—	0.9	0.6	0.6
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	167,040	168,555	952,340	0.8	—	0.5	0.2	0.1
	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	55,590	64,159	8,386,299	7.0	—	4.1	2.1	0.8
イタリア	80,100	91,478	11,957,119	9.9	—	5.8	2.8	1.3
フランス	80,470	94,252	12,319,737	10.2	—	6.6	2.5	1.2
オランダ	17,030	19,836	2,592,832	2.2	—	1.4	0.6	0.2
スペイン	47,660	56,177	7,342,959	6.1	—	4.0	1.3	0.8
ベルギー	19,290	23,245	3,038,443	2.5	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	12,260	14,151	1,849,737	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	5,300	5,741	750,441	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	7,100	7,913	1,034,360	0.9	—	0.5	0.2	0.1
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	45,675	55,958	8,296,977	6.9	—	5.1	1.4	0.5
	千スイスフラン	千スイスフラン						
スイス	1,540	1,800	197,039	0.2	—	0.0	0.1	0.0
	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ						
スウェーデン	32,340	36,532	464,694	0.4	—	0.2	0.2	—
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	25,660	26,623	363,676	0.3	—	0.2	0.1	0.1
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	32,990	40,549	711,246	0.6	—	0.4	0.1	0.1
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	24,390	25,027	767,581	0.6	—	0.2	0.3	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	29,050	30,581	2,527,876	2.1	—	1.3	0.6	0.2
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	5,860	5,940	487,132	0.4	—	0.2	0.1	0.1
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	19,850	19,638	538,678	0.4	—	0.2	0.2	0.1
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	92,450	87,254	779,180	0.6	0.6	0.6	0.1	0.0
合 計	—	—	119,000,756	98.9	0.6	53.2	31.4	14.4

(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	0.75 T-NOTE 190715	0.75	3,000	2,945	321,947	2019/7/15
		0.75 T-NOTE 190815	0.75	2,300	2,253	246,315	2019/8/15
		0.875 T-NOTE 190515	0.875	1,700	1,675	183,199	2019/5/15
		0.875 T-NOTE 190615	0.875	1,600	1,575	172,183	2019/6/15
		0.875 T-NOTE 190731	0.875	700	687	75,142	2019/7/31
		0.875 T-NOTE 190915	0.875	3,200	3,134	342,645	2019/9/15
		1 T-NOTE 190630	1.0	1,100	1,083	118,446	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	1.0	600	589	64,404	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1.0	1,200	1,176	128,604	2019/9/30
		1 T-NOTE 191015	1.0	1,400	1,371	149,931	2019/10/15
		1 T-NOTE 191115	1.0	2,500	2,445	267,350	2019/11/15
		1 T-NOTE 191130	1.0	1,500	1,466	160,314	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,100	1,086	118,761	2019/5/31
		1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,600	1,565	171,097	2019/12/31
		1.125 T-NOTE 200331	1.125	1,300	1,266	138,428	2020/3/31
		1.125 T-NOTE 200430	1.125	1,500	1,459	159,494	2020/4/30
		1.125 T-NOTE 210228	1.125	2,600	2,491	272,349	2021/2/28
		1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,000	1,905	208,252	2021/6/30
		1.125 T-NOTE 210731	1.125	1,600	1,521	166,315	2021/7/31
		1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,200	2,088	228,326	2021/8/31
		1.125 T-NOTE 210930	1.125	2,100	1,990	217,625	2021/9/30
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	600	594	64,940	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 190630	1.25	2,500	2,469	269,955	2019/6/30
		1.25 T-NOTE 190831	1.25	1,000	985	107,691	2019/8/31
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	1,200	1,179	128,902	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,600	1,566	171,220	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,350	1,319	144,282	2020/2/29
		1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,000	960	104,980	2021/3/31
		1.25 T-NOTE 211031	1.25	2,000	1,901	207,859	2021/10/31
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,800	1,660	181,524	2023/7/31
		1.375 T-NOTE 190930	1.375	2,800	2,759	301,656	2019/9/30
		1.375 T-NOTE 191215	1.375	3,100	3,046	333,023	2019/12/15
		1.375 T-NOTE 200115	1.375	300	294	32,187	2020/1/15
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,150	1,128	123,339	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200215	1.375	1,500	1,470	160,743	2020/2/15
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,000	1,959	214,196	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	3,250	3,181	347,736	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	2,000	1,955	213,718	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,700	1,659	181,399	2020/5/31
		1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,950	2,868	313,571	2020/8/31
		1.375 T-NOTE 200915	1.375	800	777	85,005	2020/9/15
		1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,900	1,845	201,734	2020/9/30
		1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,550	2,473	270,378	2020/10/31
		1.375 T-NOTE 210131	1.375	2,200	2,125	232,384	2021/1/31
		1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,400	2,310	252,526	2021/4/30
		1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,400	2,307	252,178	2021/5/31

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,100	1,952	213,464	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,150	1,993	217,922	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,100	1,944	212,549	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,300	2,280	249,301	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	1,300	1,282	140,143	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,856	312,293	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200415	1.5	1,750	1,715	187,533	2020/4/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	2,000	1,957	213,957	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 200615	1.5	2,600	2,543	278,022	2020/6/15
	1.5 T-NOTE 200815	1.5	2,000	1,951	213,333	2020/8/15
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,300	2,197	240,177	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	2,300	2,163	236,446	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	3,250	3,052	333,720	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,050	4,508	492,846	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	900	894	97,775	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	4,250	4,216	460,938	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,200	1,189	130,019	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	2,500	2,474	270,510	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,900	1,873	204,817	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200315	1.625	2,800	2,754	301,058	2020/3/15
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,900	1,862	203,583	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	2,200	2,154	235,465	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201015	1.625	1,200	1,171	128,082	2020/10/15
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,900	1,852	202,448	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,619	177,080	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 220831	1.625	5,100	4,857	531,000	2022/8/31
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	1,300	1,234	134,975	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,450	2,312	252,828	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	1,500	1,414	154,613	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,500	1,406	153,768	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	3,700	3,359	367,193	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	3,150	2,850	311,534	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,300	2,278	249,075	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	2,200	2,153	235,352	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201115	1.75	2,200	2,152	235,287	2020/11/15
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,600	1,563	170,865	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	3,500	3,381	369,612	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	1,900	1,830	200,046	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,100	2,020	220,906	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,100	1,057	115,581	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,400	1,345	147,038	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,700	1,632	178,466	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220630	1.75	5,850	5,613	613,585	2022/6/30
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,800	1,721	188,195	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,700	2,572	281,164	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	3,050	2,895	316,517	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	2,420	2,384	260,655	2020/6/30

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
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. 875 T-NOTE 201215	1. 875	3, 200	3, 138	343, 028	2020/12/15
	1. 875 T-NOTE 211130	1. 875	2, 300	2, 232	244, 047	2021/11/30
	1. 875 T-NOTE 220131	1. 875	2, 550	2, 469	269, 964	2022/ 1 / 31
	1. 875 T-NOTE 220228	1. 875	2, 100	2, 032	222, 162	2022/ 2 / 28
	1. 875 T-NOTE 220331	1. 875	2, 450	2, 368	258, 917	2022/ 3 / 31
	1. 875 T-NOTE 220430	1. 875	400	386	42, 234	2022/ 4 / 30
	1. 875 T-NOTE 220531	1. 875	2, 000	1, 930	211, 019	2022/ 5 / 31
	1. 875 T-NOTE 220731	1. 875	3, 000	2, 890	315, 914	2022/ 7 / 31
	1. 875 T-NOTE 220831	1. 875	1, 500	1, 443	157, 816	2022/ 8 / 31
	1. 875 T-NOTE 220930	1. 875	2, 000	1, 923	210, 216	2022/ 9 / 30
	1. 875 T-NOTE 221031	1. 875	2, 700	2, 594	283, 608	2022/10/31
	1. 875 T-NOTE 240831	1. 875	2, 200	2, 070	226, 316	2024/ 8 / 31
	2 T-NOTE 200731	2. 0	1, 400	1, 382	151, 085	2020/ 7 / 31
	2 T-NOTE 200930	2. 0	1, 600	1, 576	172, 368	2020/ 9 / 30
	2 T-NOTE 201130	2. 0	1, 100	1, 082	118, 315	2020/11/30
	2 T-NOTE 210115	2. 0	2, 900	2, 850	311, 612	2021/ 1 / 15
	2 T-NOTE 210228	2. 0	1, 300	1, 276	139, 527	2021/ 2 / 28
	2 T-NOTE 210531	2. 0	1, 700	1, 664	181, 994	2021/ 5 / 31
	2 T-NOTE 210831	2. 0	1, 850	1, 807	197, 523	2021/ 8 / 31
	2 T-NOTE 211031	2. 0	1, 700	1, 658	181, 239	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2. 0	2, 650	2, 584	282, 474	2021/11/15
	2 T-NOTE 211231	2. 0	2, 750	2, 677	292, 711	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2. 0	2, 200	2, 139	233, 906	2022/ 2 / 15
	2 T-NOTE 220731	2. 0	1, 200	1, 161	127, 001	2022/ 7 / 31
	2 T-NOTE 221031	2. 0	2, 000	1, 932	211, 190	2022/10/31
	2 T-NOTE 221130	2. 0	2, 700	2, 606	284, 945	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2. 0	3, 050	2, 937	321, 127	2023/ 2 / 15
	2 T-NOTE 240430	2. 0	1, 500	1, 426	155, 971	2024/ 4 / 30
	2 T-NOTE 240531	2. 0	1, 000	950	103, 870	2024/ 5 / 31
	2 T-NOTE 240630	2. 0	1, 600	1, 519	166, 041	2024/ 6 / 30
	2 T-NOTE 250215	2. 0	3, 600	3, 394	371, 073	2025/ 2 / 15
	2 T-NOTE 250815	2. 0	3, 050	2, 861	312, 818	2025/ 8 / 15
	2 T-NOTE 261115	2. 0	5, 650	5, 237	572, 487	2026/11/15
	2. 125 T-NOTE 200831	2. 125	1, 900	1, 879	205, 417	2020/ 8 / 31
	2. 125 T-NOTE 210131	2. 125	1, 610	1, 587	173, 500	2021/ 1 / 31
	2. 125 T-NOTE 210630	2. 125	2, 050	2, 013	220, 146	2021/ 6 / 30
	2. 125 T-NOTE 210815	2. 125	2, 800	2, 747	300, 281	2021/ 8 / 15
	2. 125 T-NOTE 210930	2. 125	2, 200	2, 156	235, 672	2021/ 9 / 30
	2. 125 T-NOTE 211231	2. 125	4, 060	3, 971	434, 125	2021/12/31
	2. 125 T-NOTE 220630	2. 125	1, 800	1, 753	191, 639	2022/ 6 / 30
	2. 125 T-NOTE 221231	2. 125	1, 650	1, 600	174, 908	2022/12/31
	2. 125 T-NOTE 231130	2. 125	1, 700	1, 635	178, 800	2023/11/30
	2. 125 T-NOTE 240229	2. 125	1, 350	1, 295	141, 596	2024/ 2 / 29
	2. 125 T-NOTE 240331	2. 125	1, 900	1, 821	199, 121	2024/ 3 / 31
	2. 125 T-NOTE 240731	2. 125	1, 750	1, 672	182, 788	2024/ 7 / 31
	2. 125 T-NOTE 240930	2. 125	2, 250	2, 146	234, 649	2024/ 9 / 30
	2. 125 T-NOTE 241130	2. 125	1, 900	1, 809	197, 839	2024/11/30

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	2.125 T-NOTE 250515	2.125	4,900	4,648	508,084	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	2,450	2,054	224,625	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 200229	2.25	2,400	2,388	261,104	2020/2/29
	2.25 T-NOTE 210215	2.25	1,200	1,186	129,721	2021/2/15
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,600	1,580	172,791	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,800	1,777	194,267	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,400	1,379	150,798	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	1,900	1,838	200,971	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	1,300	1,256	137,373	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,000	1,921	209,994	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,650	4,465	488,158	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 241231	2.25	2,500	2,398	262,151	2024/12/31
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	3,350	3,191	348,880	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	5,750	5,428	593,373	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	2,900	2,728	298,301	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	3,500	3,288	359,510	2027/11/15
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	800	794	86,819	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 210315	2.375	1,000	991	108,409	2021/3/15
	2.375 T-NOTE 210415	2.375	3,500	3,469	379,252	2021/4/15
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	3,800	3,684	402,754	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	3,150	3,000	327,997	2027/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	2,800	2,491	272,304	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	1,700	1,507	164,790	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	3,050	2,703	295,523	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,400	3,341	365,266	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,350	4,255	465,171	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,200	2,142	234,206	2025/1/31
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,300	2,301	251,530	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	3,200	3,198	349,600	2020/11/15
	2.625 T-NOTE 230228	2.625	1,600	1,585	173,324	2023/2/28
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	1,300	1,274	139,327	2025/3/31
	2.75 T-BOND 420815	2.75	1,450	1,366	149,336	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	1,550	1,458	159,410	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	1,840	1,712	187,208	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	1,300	1,209	132,200	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,050	4,026	440,111	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,200	3,178	347,387	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	550	543	59,444	2025/2/28
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	4,400	4,314	471,607	2028/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	2,800	2,691	294,207	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	2,800	2,680	292,964	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	3,450	3,296	360,296	2046/11/15
	3 T-BOND 420515	3.0	950	936	102,351	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	3,550	3,483	380,774	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	2,750	2,696	294,801	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	2,750	2,696	294,778	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	3,500	3,428	374,783	2047/2/15

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
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 T-BOND 470515	3.0	1,950	1,909	208,724	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	3,150	3,082	336,928	2048/2/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	800	805	88,076	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	900	906	99,086	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,700	1,708	186,712	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	2,700	2,710	296,266	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,200	2,217	242,398	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	600	607	66,377	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	2,200	2,306	252,149	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,000	3,039	332,298	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,070	116,987	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,100	2,138	233,720	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	2,350	2,564	280,378	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	2,950	3,222	352,292	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	2,200	2,233	244,108	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	2,900	2,954	322,967	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,900	2,973	325,023	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,111	121,462	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,900	3,230	353,082	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,000	1,129	123,486	2040/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	500	592	64,817	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	350	416	45,572	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	450	539	58,958	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	500	603	66,017	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,250	1,512	165,278	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,300	1,577	172,488	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	950	1,143	125,035	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	1,410	1,719	187,950	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	400	490	53,616	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,700	2,122	231,978	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,000	1,273	139,242	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	350	449	49,165	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	400	481	52,619	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	300	362	39,597	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	900	1,126	123,123	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	732	80,112	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	400	484	52,994	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	600	755	82,617	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	1,130	1,317	143,997	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	550	729	79,779	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	1,200	1,518	166,024	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	600	704	77,058	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	642	70,251	2019/8/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	800	907	99,215	2020/8/15
小計					51,103,150	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,100	1,033	88,438	2022/3/1

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
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
国債証券	0.75 CAN GOVT 190501	0.75	600	594	50,870	2019/5/1
	0.75 CAN GOVT 190801	0.75	600	592	50,700	2019/8/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,650	1,603	137,214	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	850	819	70,127	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	1,000	956	81,838	2021/9/1
	1 CAN GOVT 220901	1.0	1,050	999	85,477	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	950	844	72,257	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 191101	1.25	900	892	76,311	2019/11/1
	1.25 CAN GOVT 200201	1.25	1,420	1,403	120,104	2020/2/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	1,000	992	84,870	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	850	820	70,163	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	800	750	64,225	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,850	1,848	158,113	2019/9/1
	1.75 CAN GOVT 200501	1.75	700	697	59,636	2020/5/1
	1.75 CAN GOVT 230301	1.75	800	783	67,002	2023/3/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	390	376	32,235	2028/6/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	650	647	55,367	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,000	1,011	86,550	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	850	869	74,353	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	980	1,050	89,841	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	310	341	29,243	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,000	1,033	88,448	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	900	927	79,327	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,050	1,274	109,063	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,050	1,071	91,701	2019/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,000	1,274	109,006	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	850	1,182	101,132	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	850	1,125	96,268	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	800	1,134	97,065	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	500	728	62,289	2027/6/1
小 計					2,539,248	
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	17,300	19,523	110,307	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,100	5,012	28,318	2036/11/20
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	17,050	16,440	92,886	2019/12/11
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	9,700	8,666	48,964	2026/3/5
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	25,700	24,992	141,210	2021/6/10
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	13,400	12,917	72,984	2022/6/9
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	12,700	12,621	71,308	2027/6/3
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,450	9,506	53,714	2031/5/29
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	7,000	7,017	39,649	2034/11/23
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	13,240	13,210	74,639	2042/11/13
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	15,000	15,169	85,707	2020/6/11
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	6,350	6,485	36,644	2023/12/7
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	4,350	4,462	25,213	2047/11/7
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	5,500	5,856	33,086	2029/5/31

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	
メキシコ	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	6,200	6,673	37,705	2038/11/18
小 計						952,340	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,900	1,842	240,771	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,450	1,466	191,633	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	1,250	1,266	165,481	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	1,000	1,012	132,280	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	1,000	1,010	132,036	2022/4/8
		0 OBL 221007	—	900	906	118,479	2022/10/7
		0 SCHATS 190614	—	500	503	65,821	2019/6/14
		0 SCHATS 190913	—	200	201	26,367	2019/9/13
		0 SCHATS 191213	—	800	807	105,600	2019/12/13
		0.25 BUND 270215	0.25	1,250	1,230	160,882	2027/2/15
		0.25 OBL 191011	0.25	1,500	1,518	198,515	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,350	1,375	179,745	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	1,250	1,275	166,749	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	1,900	1,927	251,945	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	1,450	1,450	189,649	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	950	944	123,451	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	1,150	1,212	158,460	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,550	1,633	213,573	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	400	400	52,399	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,395	182,404	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,000	1,077	140,822	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,150	1,240	162,126	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,150	1,246	162,958	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,600	1,731	226,372	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,150	1,261	164,926	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,700	1,843	241,004	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,800	1,991	260,253	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,000	1,064	139,165	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	800	869	113,693	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,500	1,619	211,664	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,400	1,818	237,708	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,640	2,150	281,091	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	2,000	2,152	281,400	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,200	1,277	166,943	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,800	2,008	262,481	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	950	1,379	180,336	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,150	1,204	157,465	2019/7/4
		4 BUND 370104	4.0	1,450	2,195	287,032	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,050	1,689	220,806	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	500	707	92,491	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,300	2,054	268,587	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,000	1,728	225,965	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,200	1,895	247,728	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	950	1,408	184,169	2028/1/4

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	6.25 BUND 240104	6.25	700	945	123,538	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	600	978	127,941	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	800	1,234	161,372	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 191015	0.05	800	803	105,064	2019/10/15
		0.2 ITALY GOVT 201015	0.2	400	402	52,588	2020/10/15
		0.35 ITALY GOVT 200615	0.35	550	555	72,628	2020/6/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	401	52,485	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,100	1,111	145,257	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	600	610	79,795	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	900	890	116,340	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,050	1,068	139,600	2020/5/1
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	450	457	59,752	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,000	1,011	132,264	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	1,500	1,530	200,074	2019/12/1
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	900	927	121,203	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,261	164,941	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,150	1,191	155,678	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	900	934	122,152	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	400	406	53,090	2024/11/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,200	1,226	160,330	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,100	1,111	145,292	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,100	1,103	144,234	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,600	1,490	194,820	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	850	888	116,144	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,200	1,246	162,900	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	400	404	52,851	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,100	1,124	146,945	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,000	1,066	139,371	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,100	1,140	149,108	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,250	1,201	157,038	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	100	100	13,181	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,000	1,027	134,281	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,800	1,945	254,311	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	850	819	107,173	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	510	469	61,348	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	700	729	95,403	2038/9/1
3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,150	1,233	161,192	2046/9/1		
3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,020	1,115	145,760	2048/3/1		
3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,596	208,698	2030/3/1		
3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,600	1,766	230,837	2021/3/1		
3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,800	1,993	260,628	2021/5/1		
3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,100	2,340	305,944	2021/8/1		
3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,200	1,390	181,715	2024/9/1		
4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,450	1,586	207,357	2020/9/1		
4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,500	1,823	238,397	2037/2/1		
4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,400	2,542	332,316	2019/9/1		
4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,650	1,782	233,045	2020/3/1		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,100	2,270	296,776	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,300	1,538	201,052	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,350	1,615	211,103	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,450	1,771	231,579	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	3,000	3,448	450,773	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,700	2,044	267,203	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,500	1,890	247,135	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,270	1,702	222,586	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,500	1,762	230,322	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,350	1,678	219,449	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,150	2,888	377,502	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,300	1,776	232,170	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,300	1,773	231,843	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,600	2,120	277,214	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,150	1,393	182,110	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,000	1,216	158,949	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,450	2,060	269,327	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,950	2,779	363,361	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,000	2,820	368,654	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	950	1,374	179,673	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,200	1,719	224,778	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 200225	—	1,500	1,513	197,871	2020/2/25
		0 O. A. T 200525	—	1,550	1,565	204,621	2020/5/25
		0 O. A. T 210225	—	600	605	79,204	2021/2/25
		0 O. A. T 210525	—	1,700	1,716	224,352	2021/5/25
		0 O. A. T 220525	—	1,750	1,758	229,889	2022/5/25
		0 O. A. T 230325	—	400	399	52,167	2023/3/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	1,200	1,220	159,498	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	2,000	1,944	254,215	2026/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,850	1,879	245,713	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,350	1,362	178,148	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	1,400	1,398	182,784	2026/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	800	796	104,165	2028/5/25
		1 O. A. T 190525	1.0	1,200	1,219	159,362	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	2,170	2,259	295,357	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	2,050	2,110	275,906	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	300	302	39,528	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	1,450	1,438	188,060	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	2,300	2,432	317,890	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	2,450	2,659	347,680	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	2,200	2,406	314,617	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	640	681	89,053	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	770	755	98,708	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	1,090	1,178	154,101	2048/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	2,350	2,592	338,843	2022/10/25
2.25 O. A. T 240525	2.25	2,300	2,580	337,357	2024/5/25		
2.5 O. A. T 201025	2.5	2,400	2,573	336,383	2020/10/25		

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	2.5 O.A.T 300525	2.5	2,550	3,002	392,475	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	2,450	2,915	381,031	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,000	3,376	441,350	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	2,600	2,915	381,069	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,770	2,428	317,390	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,800	3,018	394,591	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,650	3,281	428,944	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	2,400	2,549	333,308	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	2,200	2,467	322,540	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,700	2,515	328,851	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,100	1,784	233,299	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	730	1,215	158,925	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	2,950	3,616	472,664	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,070	3,323	434,365	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	1,730	2,683	350,714	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	1,900	2,832	370,223	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,250	3,672	480,004	2032/10/25
6 O.A.T 251025	6.0	2,300	3,255	425,528	2025/10/25		
8.5 O.A.T 191025	8.5	550	622	81,386	2019/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	1,000	1,419	185,585	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	550	554	72,510	2022/1/15
		0 NETH GOVT 240115	—	650	644	84,302	2024/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	800	811	106,079	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	900	894	116,869	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,000	1,002	131,094	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	980	994	129,976	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	450	452	59,103	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,089	142,397	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	950	1,055	137,966	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	900	991	129,560	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	800	970	126,872	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	850	1,161	151,833	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,600	1,784	233,304	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	750	816	106,695	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	300	353	46,247	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,000	1,543	201,804	2042/1/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,100	1,160	151,624	2019/7/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	950	1,430	186,991	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	850	1,242	162,461	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	650	880	115,137	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	1,200	1,215	158,932	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	550	556	72,697	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,300	1,335	174,556	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,300	1,341	175,331	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,300	1,326	173,380	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,550	1,596	208,683	2020/1/31
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	1,200	1,225	160,234	2027/10/31

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	1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,050	1,082	141,430	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,700	1,798	235,083	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,400	1,504	196,663	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,050	2,144	280,359	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,300	1,420	185,612	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	290	310	40,644	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	500	531	69,494	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,650	1,700	222,219	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,550	1,757	229,712	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,130	1,264	165,276	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	480	582	76,115	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,300	1,547	202,218	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,200	1,301	170,116	2020/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,700	2,302	301,005	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,500	1,603	209,547	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,350	1,639	214,305	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,500	1,591	208,027	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,550	1,969	257,379	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,160	1,701	222,461	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,100	1,367	178,774	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,650	1,856	242,690	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,100	1,642	214,671	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	950	1,304	170,540	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	900	1,418	185,420	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,350	1,676	219,081	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,700	1,984	259,347	2021/4/30
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,350	2,054	268,523	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,650	2,008	262,530	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,300	1,802	235,554	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,850	2,710	354,334	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	200	200	26,225	2023/10/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	300	303	39,610	2024/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,300	1,333	174,345	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	700	706	92,321	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	300	299	39,121	2028/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,100	1,137	148,664	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	650	644	84,291	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	390	394	51,586	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	500	495	64,795	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	400	434	56,749	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	250	270	35,352	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	820	912	119,258	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	170	190	24,958	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,300	1,484	194,072	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	750	786	102,794	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	200	251	32,886	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,200	1,320	172,566	2020/9/28

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	
			千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	3.75 BEL GOVT 450622	3.75	770	1,140	149,023	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	750	872	114,078	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	620	855	111,839	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,150	1,327	173,461	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,100	1,310	171,242	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,050	1,623	212,218	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	500	655	85,710	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,520	2,398	313,525	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,300	1,895	247,741	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 220920	—	400	401	52,444	2022/9/20
		0 AUSTRIA GOVT 230715	—	350	348	45,511	2023/7/15
		0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	400	404	52,859	2019/10/18
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	400	394	51,580	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	800	810	105,953	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	450	449	58,771	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	800	844	110,343	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	310	311	40,660	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	150	133	17,443	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	700	760	99,435	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	800	871	113,867	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	500	513	67,133	2019/6/18
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	250	272	35,622	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	350	414	54,148	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	450	624	81,584	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	650	752	98,296	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	850	957	125,205	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	689	90,179	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	230	387	50,691	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	820	898	117,388	2020/7/15
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	900	1,348	176,246	2037/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	550	737	96,338	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	550	826	108,029	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	250	251	32,851	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	500	497	64,963	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	407	53,277	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	400	52,351	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	200	197	25,750	2027/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	300	292	38,252	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	100	103	13,512	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	200	200	26,223	2034/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	250	267	35,018	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	322	42,139	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	200	221	28,905	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	300	389	50,853	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	359	47,030	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	450	483	63,224	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	400	445	58,180	2021/4/15

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	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
フィンランド	国債証券	4 FINNISH GOVT 250704	4.0	550	690	90,276	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	200	211	27,627	2019/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 221018	—	250	249	32,605	2022/10/18
		0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	500	517	67,627	2022/3/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	300	298	38,975	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	600	615	80,393	2026/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	300	297	38,875	2033/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	350	360	47,063	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	500	531	69,505	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	600	685	89,642	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	708	92,610	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	300	355	46,444	2023/3/20
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	850	932	121,844	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	750	849	110,983	2020/10/18
5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	850	1,131	147,842	2025/3/13		
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	350	382	49,946	2019/10/18		
小 計						49,271,931	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
イギリス	国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	1,500	1,468	217,800	2022/7/22
		0.75 GILT 230722	0.75	750	735	109,063	2023/7/22
		1.25 GILT 270722	1.25	1,050	1,029	152,613	2027/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	1,720	1,750	259,555	2021/1/22
		1.5 GILT 260722	1.5	1,910	1,930	286,161	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	980	898	133,229	2047/7/22
		1.75 GILT 190722	1.75	1,000	1,012	150,136	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	1,540	1,588	235,477	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	620	608	90,272	2037/9/7
		1.75 GILT 570722	1.75	610	615	91,239	2057/7/22
		2 GILT 200722	2.0	2,050	2,104	311,962	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	1,150	1,209	179,263	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	1,200	1,269	188,244	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	1,050	1,334	197,909	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,150	1,258	186,530	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	1,850	2,357	349,509	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,770	2,362	350,275	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,340	2,170	321,752	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	1,300	1,352	200,502	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	1,200	1,282	190,131	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	900	984	145,956	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	1,270	1,902	282,046	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	850	947	140,537	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	910	1,535	227,674	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	750	937	138,989	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	1,100	1,447	214,611	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	1,405	1,926	285,666	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	750	1,064	157,818	2039/9/7
4.25 GILT 401207	4.25	1,240	1,782	264,364	2040/12/7		

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	4.25 GILT 461207	4.25	1,100	1,673	248,119	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	820	1,292	191,568	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,020	1,722	255,412	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,310	1,812	268,761	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,100	1,665	246,945	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	1,200	1,287	190,860	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	920	1,243	184,330	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	800	1,196	177,464	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	950	1,183	175,497	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	640	919	136,322	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	900	1,095	162,394	2021/6/7
小	計					8,296,977	
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	260	280	30,706	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	260	276	30,311	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	350	363	39,766	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	300	364	39,864	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	370	515	56,390	2028/4/8
小	計					197,039	
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	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	3,450	3,459	44,007	2028/5/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	3,960	4,111	52,296	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,000	5,380	68,443	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	3,830	4,405	56,032	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,950	7,981	101,527	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,050	4,235	53,874	2039/3/30
		5 SWD GOVT 201201	5.0	6,100	6,958	88,513	2020/12/1
小	計					464,694	
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	2,560	2,516	34,369	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,800	2,816	38,476	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,750	1,738	23,747	2027/2/17
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,750	4,873	66,572	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,150	3,399	46,442	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	5,750	6,193	84,601	2021/5/25
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	4,900	5,085	69,467	2019/5/22
小	計					363,676	
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 201115	0.25	1,700	1,731	30,368	2020/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	3,350	3,327	58,368	2027/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,150	3,401	59,664	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,350	5,922	103,872	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	6,170	6,887	120,815	2021/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	4,750	5,081	89,131	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	8,520	14,197	249,026	2039/11/15
小	計					711,246	

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	1.5 POLAND 200425	1.5	2,200	2,201	67,521	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	1,900	1,890	57,993	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	2,220	2,230	68,407	2021/4/25
	2.25 POLAND 220425	2.25	850	851	26,121	2022/4/25
	2.5 POLAND 230125	2.5	700	701	21,507	2023/1/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	2,650	2,538	77,849	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	2,050	1,941	59,542	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	450	432	13,272	2028/4/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	1,000	1,022	31,372	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,750	1,780	54,598	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,800	1,925	59,062	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	700	760	23,326	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,650	1,748	53,611	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,700	1,911	58,617	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,550	1,769	54,274	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	520	643	19,742	2029/4/25
	POLAND 200725	—	700	676	20,760	2020/7/25
小計					767,581	
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	1,650	1,635	135,223	2020/11/21
	2 AUST GOVT 211221	2.0	1,150	1,140	94,277	2021/12/21
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	300	298	24,671	2022/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,450	1,382	114,314	2028/5/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,400	1,415	117,030	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,550	1,569	129,746	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,600	1,597	132,030	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,400	1,394	115,246	2028/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	930	921	76,208	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	480	39,678	2035/6/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	740	700	57,938	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,550	1,611	133,245	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,550	1,614	133,487	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	350	355	29,357	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	800	874	72,302	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,600	2,888	238,730	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,750	1,831	151,403	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	850	1,007	83,294	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,820	2,107	174,237	2027/4/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,550	1,772	146,534	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,060	2,273	187,958	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,500	1,705	140,957	2022/7/15
小計					2,527,876	
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	1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	200	194	15,953	2021/10/1
	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	450	448	36,800	2019/10/1
	1.75 SINGAPORGOVT 220401	1.75	100	98	8,083	2022/4/1
	1.75 SINGAPORGOVT 230201	1.75	250	245	20,115	2023/2/1

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 SINGAPORGOVT 200701		2.0	150	150	12,313	2020/7/1
	2.125 SINGAPORGOV 260601		2.125	80	77	6,392	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601		2.25	420	422	34,625	2021/6/1
	2.25 SINGAPORGOVT 360801		2.25	50	45	3,771	2036/8/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601		2.375	300	298	24,496	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGOVT 190601		2.5	500	503	41,319	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701		2.75	450	459	37,711	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401		2.75	290	283	23,244	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301		2.75	390	378	31,008	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701		2.875	100	102	8,384	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901		2.875	300	304	25,005	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901		3.0	350	362	29,718	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901		3.125	300	312	25,640	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOVT 200901		3.25	370	380	31,207	2020/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901		3.375	310	332	27,228	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301		3.5	500	537	44,107	2027/3/1
小計						487,132	
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	883	24,235	2022/8/15
	3.48 MALAYSIAGOV 230315		3.48	1,200	1,172	32,168	2023/3/15
	3.492 MALAYSIAGOV 200331		3.492	500	498	13,660	2020/3/31
	3.502MALAYSIAGOV 270531		3.502	300	282	7,749	2027/5/31
	3.659 MALAYSIAGOV 201015		3.659	1,000	998	27,394	2020/10/15
	3.733 MALAYSIAGO 280615		3.733	600	580	15,914	2028/6/15
	3.795 MALAYSIAGOV 220930		3.795	500	497	13,659	2022/9/30
	3.8 MALAYSIAGOV 230817		3.8	200	198	5,441	2023/8/17
	3.844 MALAYSIAGOV 330415		3.844	600	550	15,110	2033/4/15
	3.882 MALAYSIAGOV 220310		3.882	500	501	13,758	2022/3/10
	3.889 MALAYSIAGO 200731		3.889	700	702	19,262	2020/7/31
	3.892 MALAYSIAGOV 270315		3.892	500	485	13,320	2027/3/15
	3.899 MALAYSIAGOV 271116		3.899	500	491	13,478	2027/11/16
	3.9 MALAYSIAGOV 261130		3.9	500	489	13,440	2026/11/30
	3.955 MALAYSIAGOV 250915		3.955	800	787	21,592	2025/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930		4.048	900	905	24,846	2021/9/30
	4.127 MALAYSIA 320415		4.127	600	574	15,752	2032/4/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715		4.16	1,050	1,060	29,101	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715		4.181	500	502	13,771	2024/7/15
	4.232MALAYSIAGOV 310630		4.232	800	772	21,186	2031/6/30
	4.254 MALAYSIAGOV 350531		4.254	350	326	8,962	2035/5/31
	4.378MALAYSIAGOV 191129		4.378	1,450	1,466	40,218	2019/11/29
	4.392 MALAYSIAGOV 260415		4.392	1,000	1,012	27,781	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415		4.498	900	902	24,743	2030/4/15
	4.736 MALAYSIAGOV 460315		4.736	1,050	1,020	28,000	2046/3/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407		4.762	1,100	1,099	30,160	2037/4/7
	4.935 MALAYSIAGOV 430930		4.935	350	352	9,671	2043/9/30
	5.248 MALAYSIA 280915		5.248	200	213	5,854	2028/9/15

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
マレーシア	%	千マレーシアリングgit	千マレーシアリングgit	千円		
国債証券	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	300	307	8,439	2019/7/30
小 計					538,678	
南アフリカ		千南アフリカランド	千南アフリカランド			
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	13,100	14,816	132,307	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	6,950	5,224	46,658	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	7,200	5,334	47,636	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,000	2,949	26,338	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	7,500	6,463	57,715	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,700	2,705	24,156	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,000	5,002	44,668	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	6,500	6,144	54,868	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,800	5,492	49,049	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	6,500	6,115	54,609	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,750	5,440	48,581	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	12,900	12,212	109,056	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	4,550	4,469	39,914	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	5,000	4,884	43,618	2040/1/31
小 計					779,180	
合 計					119,000,756	

(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

(2018年5月14日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 119,000,756	% 98.8
コール・ローン等、その他	1,420,543	1.2
投資信託財産総額	120,421,299	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (120,317,096千円) の投資信託財産総額 (120,421,299千円) に対する比率は99.9%です。

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

1 アメリカドル=109.31円	1 カナダドル=85.55円	1 メキシコペソ=5.65円	1 ユーロ=130.71円
1 イギリスポンド=148.27円	1 スイスフラン=109.44円	1 スウェーデンクローネ=12.72円	1 ノルウェークローネ=13.66円
1 デンマーククローネ=17.54円	1 ポーランドズロチ=30.67円	1 オーストラリアドル=82.66円	1 シンガポールドル=82.00円
1 マレーシアリングgit=27.43円	1 南アフリカランド=8.93円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月14日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	120,482,470,244
コール・ローン等	382,640,541
公社債(評価額)	119,000,756,263
未収入金	61,204,160
未収利息	985,077,904
前払費用	52,791,376
(B) 負債	168,022,411
未払金	61,215,500
未払解約金	106,806,776
未払利息	135
(C) 純資産総額(A-B)	120,314,447,833
元本	59,625,812,717
次期繰越損益金	60,688,635,116
(D) 受益権総口数	59,625,812,717口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,178円

<注記事項>

- ①期首元本額 66,568,708,547円
 期中追加設定元本額 12,978,166,639円
 期中一部解約元本額 19,921,062,469円
 また、1口当たり純資産額は、期末20,178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)	1,898,201,411円
eMAXIS 先進国債券インデックス	8,252,912,139円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,624,050,849円
eMAXIS バランス(波乗り型)	241,390,698円
コアバランス	1,195,755円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	5,070,504円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	4,204,102円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	3,240,941円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	895,405,076円
海外債券セレクション(ラップ向け)	845,010,550円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	709,649,229円
つみたて8資産均等バランス	74,564,206円
つみたて4資産均等バランス	15,586,778円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	501,577円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	139,217円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	31,109円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	255,781円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	260,240円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	244,941円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	8,045,517,531円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	112,484,167円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	93,144,200円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	53,555,116円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	75,995,442円
eMAXIS 最適化バランス(マイフoward)	10,589,840円

○損益の状況 (2017年5月13日~2018年5月14日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,035,018,431
受取利息	3,035,088,958
その他収益金	111,439
支払利息	△ 181,966
(B) 有価証券売買損益	△ 1,034,403,474
売買益	4,049,863,235
売買損	△ 5,084,266,709
(C) 保管費用等	△ 18,690,525
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,981,924,432
(E) 前期繰越損益金	65,861,349,740
(F) 追加信託差損益金	13,485,281,251
(G) 解約差損益金	△20,639,920,307
(H) 計(D+E+F+G)	60,688,635,116
次期繰越損益金(H)	60,688,635,116

- (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。

eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	6,378,869円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	64,116,631円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,985,725,343円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,931,215,906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)	21,752,420,274円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	1,016,187,099円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型 (適格機関投資家限定)	69,133,739円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	10,246,618円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型 (適格機関投資家限定)	125,468,912円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	51,862,103円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,484,530,937円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	104,588,898円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	126,919,234円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	93,868,823円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	9,509,559円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	274,416,168円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	2,902,304円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	6,516,238円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	6,465,385円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	2,749,152円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	56,247,683円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	46,949,860円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	75,528,100円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	62,632,295円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	114,582,522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)	1,819,512,117円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	2,004,028,877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)	218,078,519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)	576,461,118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)	414,846,856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)	148,521,179円
合計	59,625,812,717円

【お知らせ】

- ①投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について、該当する記載の整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2017年8月16日)
- ②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)
- ③使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2018年2月8日)
- ④本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、FTSE債券インデックスの名称に変更しています。