

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（2002年2月8日設定）	
運用方針	三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、ベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要運用対象	ベビーフンド	三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債、短期金融商品に直接投資することもできます。
	マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	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は制限を設けません。
分配方針	毎年1回決算（原則として8月10日。ただし、8月10日が休業日の場合は翌営業日とします。）を行い基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象収益等が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ 外国債券オープン （確定拠出年金）



第14期（決算日：2015年8月10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「三菱UFJ 外国債券オープン（確定拠出年金）」は、去る8月10日に第14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投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



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

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

（9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目 次

◀ 三菱UFJ 外国債券オープン（確定拠出年金）のご報告 ▶

◇最近5期の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	1
◇運用経過	2
◇今後の運用方針	6
◇1万口当たりの費用明細	7
◇売買及び取引の状況	7
◇利害関係人との取引状況等	8
◇組入資産の明細	8
◇投資信託財産の構成	8
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	9
◇損益の状況	9
◇お知らせ	10

◀ マザーファンドのご報告 ▶

◇三菱UFJ 外国債券マザーファンド	28
--------------------------	----

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 (分配落)	価 額			シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率			
	円		円	%		%	%	%	百万円
10期(2011年8月10日)	11,012		0	△ 4.4	286.0741	△ 3.6	98.7	—	3,004
11期(2012年8月10日)	11,002		0	△ 0.1	289.7260	1.3	98.8	—	3,165
12期(2013年8月12日)	13,917		0	26.5	370.4507	27.9	98.8	—	4,149
13期(2014年8月11日)	15,588		0	12.0	417.7483	12.8	98.9	—	4,957
14期(2015年8月10日)	17,586		0	12.8	477.2079	14.2	98.8	—	5,715

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）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。

(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合わせますので、「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 (分配落)	価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落	率	騰 落	率		
(期 首) 2014年8月11日	円 15,588		% —	417.7483	% —	98.9	% —
8 月 末	15,864		1.8	426.4201	2.1	98.8	—
9 月 末	16,296		4.5	438.1378	4.9	98.6	—
10 月 末	16,316		4.7	438.2998	4.9	98.7	—
11 月 末	17,684		13.4	475.7084	13.9	98.6	—
12 月 末	17,855		14.5	482.5458	15.5	97.8	—
2015年1 月 末	17,311		11.1	467.2651	11.9	98.6	—
2 月 末	17,342		11.3	469.4314	12.4	98.6	—
3 月 末	17,255		10.7	465.9620	11.5	98.6	—
4 月 末	17,234		10.6	467.4672	11.9	98.6	—
5 月 末	17,560		12.7	477.0137	14.2	98.8	—
6 月 末	17,276		10.8	468.9247	12.3	98.6	—
7 月 末	17,498		12.3	475.9564	13.9	98.7	—
(期 末) 2015年8月10日	円 17,586		12.8	477.2079	14.2	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合わせますので、「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。

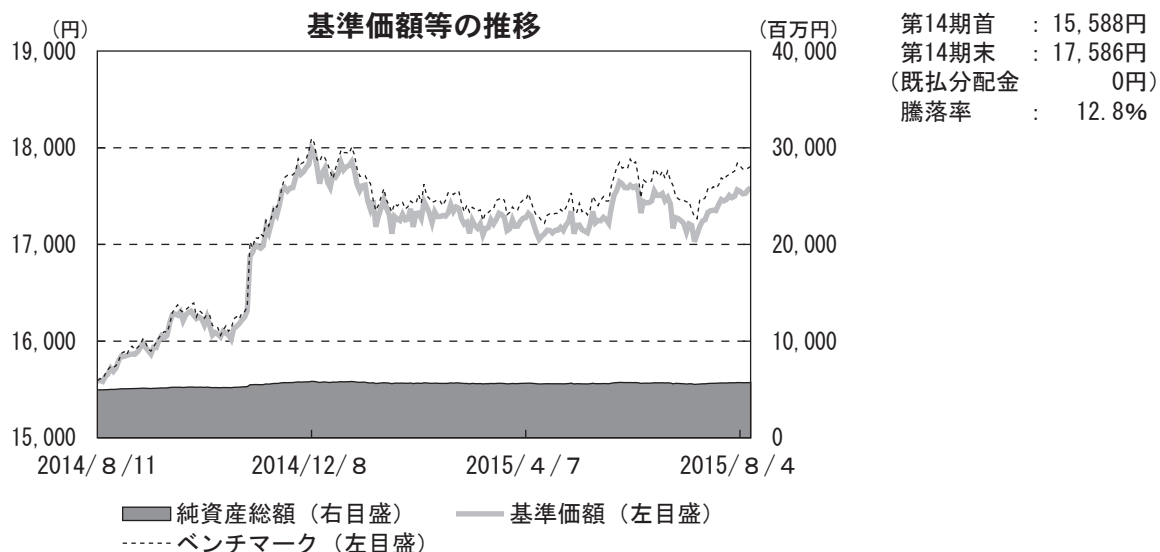
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第14期：2014/8/12～2015/8/10）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ12.8%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（14.2%）を1.4%下回りました。



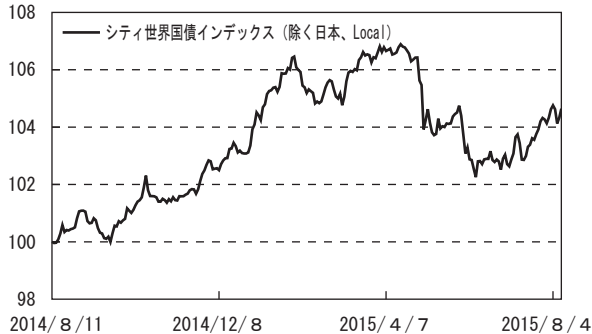
基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ・ E C B（欧州中央銀行）による追加緩和策の発表および実施や、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、金利が総じて低下（債券価格は上昇）したことが基準価額の上昇要因となりました。
- ・ 日銀による追加緩和策の発表・実施や、F R B（米連邦準備制度理事会）による利上げ観測の高まりなどから、ドルが対円で買われたことが基準価額の上昇要因になりました。

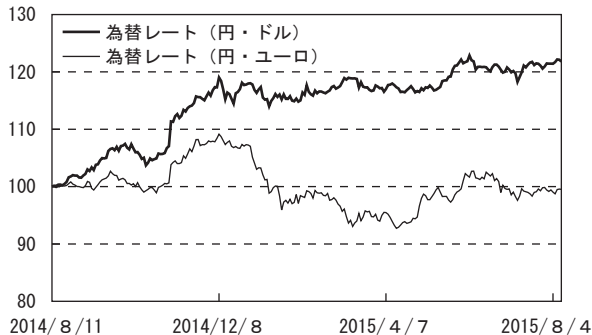
投資環境について

（第14期：2014/8/12～2015/8/10）

債券市況の推移
（期首を100として指数化）

◎債券市況

- ・ＥＣＢによる追加緩和策の発表および実施や、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、金利は総じて低下しました。

為替市況の推移
（期首を100として指数化）

◎為替市況

- ・円・ドル相場は、日銀による追加金融緩和策の発表・実施や、ＦＲＢによる利上げ観測の高まりなどから、ドルが対円で買われました。期首との比較では、ドルは対円で21.8%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、ＥＣＢによる追加緩和策の発表・実施や、ギリシャの情勢不安などを背景に、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0.5%下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）＞

- ・当ファンドは、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。

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

基準価額は期首に比べ14.0%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シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）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（2014年8月11日）

最終利回り	1.5%
直接利回り	2.8%
デュレーション	6.3年

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮していません）。
- ・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。

期末（2015年8月10日）

最終利回り	1.3%
直接利回り	2.6%
デュレーション	6.7年

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮していません）。
- ・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。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）＞

- ・基準価額とベンチマークとの乖離は $\Delta 1.4\%$ 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 との乖離	$\Delta 1.2\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 1.4\%$ 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。

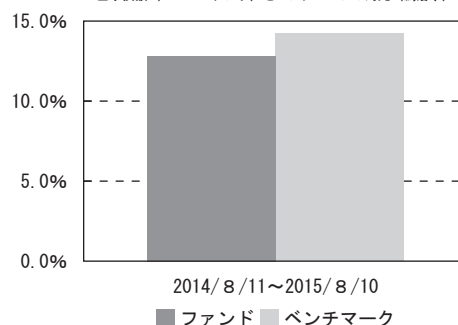
＜マザーファンド保有以外の要因＞

ファンドの管理コスト等は $\Delta 1.2\%$ 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 $\Delta 0.2\%$ 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）



＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

ベンチマークは 14.2% の上昇となったため、乖離は $\Delta 0.2\%$ 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	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 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 $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

為替の効果および債券の効果による要因です。

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

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

分配金について

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

【分配原資の内訳】（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第14期
	2014年8月12日～2015年8月10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	8,145

（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

＜三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）＞

- ・ファンドの資産のほぼ全額を三菱ＵＦＪ 外国債券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。

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

- ・今後の運用についても、当ファンドの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

(2014年８月12日～2015年８月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 184	% 1.077	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(87)	(0.512)	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)	(88)	(0.511)	分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(9)	(0.054)	投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	6	0.033	(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)	(6)	(0.033)	外国での資産の保管等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	190	1.110	
期中の平均基準価額は、17,124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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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

(2014年８月12日～2015年８月10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
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	千口 150,351	千円 404,050	千口 128,453	千円 351,244

○利害関係人との取引状況等

(2014年8月12日～2015年8月10日)

利害関係人との取引状況

<三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）>

該当事項はございません。

<三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 6,330	百万円 3,086	% 48.8	百万円 77,227	百万円 55,174	% 71.4

平均保有割合 3.9%

※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、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

(2015年8月10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
	千口	千口	千円
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	2,011,771	2,033,669	5,713,798

○投資信託財産の構成

(2015年8月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	5,713,798	99.3
コール・ローン等、その他	39,677	0.7
投資信託財産総額	5,753,475	100.0

(注) 三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（117,621,680千円）の投資信託財産総額（117,864,937千円）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=124.42 円	1 カナダドル=94.61 円	1 メキシコペソ=7.70 円	1 ユーロ=136.25 円
1 イギリスポンド=192.69 円	1 スイスフラン=126.37 円	1 スウェーデンクローネ=14.16 円	1 ノルウェークローネ=15.05 円
1 デンマーククローネ=18.26 円	1 ポーランドズロチ=32.55 円	1 オーストラリアドル=92.02 円	1 シンガポールドル=89.81 円
1 マレーシアリンギット=31.70 円	1 南アフリカランド=9.84 円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2015年8月10日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,753,475,950
コール・ローン等	33,435,697
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド(評価額)	5,713,798,099
未収入金	6,242,100
未収利息	54
(B) 負債	38,441,494
未払解約金	8,427,484
未払信託報酬	30,014,010
(C) 純資産総額(A－B)	5,715,034,456
元本	3,249,834,266
次期繰越損益金	2,465,200,190
(D) 受益権総口数	3,249,834,266口
1万口当たり基準価額(C／D)	17,586円

<注記事項>

①期首元本額	3,180,363,172円
期中追加設定元本額	535,888,243円
期中一部解約元本額	466,417,149円

②分配金の計算過程

項 目	2014年8月12日～ 2015年8月10日
費用控除後の配当等収益額	136,493,217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	440,648,118円
収益調整金額	1,299,589,854円
分配準備積立金額	770,533,720円
当ファンドの分配対象収益額	2,647,264,909円
1万口当たり収益分配対象額	8,145円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2014年8月12日～2015年8月10日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	11,159
受取利息	11,159
(B) 有価証券売買損益	636,855,427
売買益	706,310,185
売買損	△ 69,454,758
(C) 信託報酬等	△ 59,725,251
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	577,141,335
(E) 前期繰越損益金	770,533,720
(F) 追加信託差損益金	1,117,525,135
(配当等相当額)	(1,298,871,883)
(売買損益相当額)	(△ 181,346,748)
(G) 計(D＋E＋F)	2,465,200,190
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	2,465,200,190
追加信託差損益金	1,117,525,135
(配当等相当額)	(1,299,589,854)
(売買損益相当額)	(△ 182,064,719)
分配準備積立金	1,347,675,055

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

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

【お 知 ら せ】

- ①運用報告書の二段階化について信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ③デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ④2015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)

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2015年8月10日現在）

<三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド>

下記は、三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド全体(41,768,999千口)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 385,100	千アメリカドル 398,067	千円 49,527,536	% 42.2	% —	% 16.5	% 15.2	% 10.5
カナダ	千カナダドル 23,000	千カナダドル 26,207	2,479,461	2.1	—	1.0	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 136,900	千メキシコペソ 152,863	1,177,045	1.0	—	0.6	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	53,900	63,421	8,641,129	7.4	—	4.2	2.1	1.1
イタリア	70,600	83,698	11,403,981	9.7	—	6.0	2.5	1.2
フランス	68,050	80,981	11,033,785	9.4	—	5.8	2.6	1.0
オランダ	18,000	21,141	2,880,509	2.5	—	1.3	0.8	0.4
スペイン	38,100	44,688	6,088,871	5.2	—	3.0	1.5	0.7
ベルギー	17,750	21,918	2,986,424	2.5	—	1.8	0.4	0.3
オーストリア	11,400	13,705	1,867,394	1.6	—	0.9	0.5	0.2
フィンランド	4,400	4,937	672,764	0.6	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	5,650	6,719	915,502	0.8	—	0.4	0.4	—
イギリス	千イギリスポンド 44,400	千イギリスポンド 52,962	10,205,289	8.7	—	6.1	2.1	0.4
スイス	千スイスフラン 2,220	千スイスフラン 2,684	339,213	0.3	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 29,500	千スウェーデンクローネ 34,936	494,694	0.4	—	0.3	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 19,700	千ノルウェークローネ 21,690	326,444	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 34,600	千デンマーククローネ 43,528	794,835	0.7	—	0.5	0.2	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 18,200	千ポーランドズロチ 19,583	637,430	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 18,850	千オーストラリアドル 20,688	1,903,745	1.6	—	1.0	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 4,750	千シンガポールドル 4,875	437,863	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 17,800	千マレーシアリンギット 17,704	561,240	0.5	—	0.2	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 64,100	千南アフリカランド 61,890	609,000	0.5	—	0.4	0.1	—
合 計	—	—	115,984,166	98.8	—	51.2	30.7	16.9

(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			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	0.5 T-NOTE 170731	0.5	2,500	2,488	309,616	2017/7/31	
	0.625 T-NOTE 161015	0.625	2,600	2,604	324,111	2016/10/15	
	0.625 T-NOTE 161115	0.625	3,000	3,004	373,828	2016/11/15	
	0.625 T-NOTE 170215	0.625	2,700	2,700	336,025	2017/2/15	
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	3,400	3,395	422,449	2017/5/31	
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	3,500	3,489	434,109	2017/8/31	
	0.625 T-NOTE 170930	0.625	3,000	2,988	371,816	2017/9/30	
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	1,400	1,392	173,255	2017/11/30	
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	800	791	98,532	2018/4/30	
	0.75 T-NOTE 170315	0.75	2,900	2,906	361,593	2017/3/15	
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	3,300	3,302	410,842	2017/6/30	
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	3,000	2,994	372,574	2017/10/31	
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	2,700	2,690	334,792	2017/12/31	
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	1,500	1,492	185,674	2018/2/28	
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	400	397	49,478	2018/3/31	
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	500	496	61,809	2018/4/15	
	0.875 T-NOTE 160915	0.875	3,900	3,918	487,531	2016/9/15	
	0.875 T-NOTE 161130	0.875	3,100	3,114	387,494	2016/11/30	
	0.875 T-NOTE 161231	0.875	3,400	3,415	424,928	2016/12/31	
	0.875 T-NOTE 170131	0.875	3,600	3,615	449,819	2017/1/31	
	0.875 T-NOTE 170228	0.875	3,300	3,313	412,270	2017/2/28	
	0.875 T-NOTE 170415	0.875	1,500	1,505	187,322	2017/4/15	
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	2,900	2,910	362,114	2017/4/30	
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	3,000	3,009	374,470	2017/5/15	
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	3,500	3,510	436,813	2017/6/15	
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	1,300	1,302	162,093	2017/8/15	
	0.875 T-NOTE 171015	0.875	1,300	1,301	161,916	2017/10/15	
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	1,400	1,398	173,990	2018/1/31	
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	1,000	980	121,994	2019/7/31	
	1 T-NOTE 160831	1.0	3,700	3,722	463,141	2016/8/31	
	1 T-NOTE 160930	1.0	4,500	4,527	563,367	2016/9/30	
	1 T-NOTE 161031	1.0	3,300	3,320	413,136	2016/10/31	
	1 T-NOTE 170331	1.0	3,500	3,520	438,038	2017/3/31	
	1 T-NOTE 170915	1.0	2,000	2,008	249,918	2017/9/15	
	1 T-NOTE 180315	1.0	500	500	62,265	2018/3/15	
	1 T-NOTE 190630	1.0	700	690	85,964	2019/6/30	
	1 T-NOTE 190831	1.0	1,400	1,377	171,411	2019/8/31	
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,000	982	122,300	2019/9/30	
	1 T-NOTE 191130	1.0	2,200	2,157	268,409	2019/11/30	
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	4,900	4,911	611,063	2018/6/15	
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	700	694	86,461	2019/5/31	
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,900	1,871	232,870	2019/12/31	
	1.125 T-NOTE 200331	1.125	1,400	1,373	170,915	2020/3/31	
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,900	2,904	361,395	2018/11/30	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,000	1,999	248,781	2019/ 1 /31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	800	798	99,361	2019/ 4 /30
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	1,500	1,489	185,281	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	3,200	3,164	393,695	2020/ 1 /31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	100	98	12,294	2020/ 2 /29
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	2,600	2,618	325,791	2018/ 9 /30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,100	1,106	137,728	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,400	1,407	175,099	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,700	1,705	212,224	2019/ 2 /28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,900	1,889	235,132	2020/ 1 /31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,900	2,883	358,732	2020/ 2 /29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,500	2,482	308,862	2020/ 3 /31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	2,800	2,778	345,681	2020/ 4 /30
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	1,000	1,011	125,858	2018/ 8 /31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,800	2,824	351,424	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,600	2,620	326,044	2019/ 1 /31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,200	2,216	275,776	2019/ 2 /28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	900	906	112,817	2019/ 3 /31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,000	2,011	250,298	2019/ 5 /31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	2,900	2,906	361,579	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	500	500	62,331	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 200531	1.5	3,700	3,690	459,131	2020/ 5 /31
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,700	2,635	327,955	2022/ 1 /31
		1.625 T-NOTE 190331	1.625	2,300	2,326	289,452	2019/ 3 /31
		1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,500	1,516	188,685	2019/ 4 /30
		1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,900	1,918	238,743	2019/ 6 /30
		1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,400	1,412	175,780	2019/ 7 /31
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	500	502	62,579	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	700	685	85,243	2022/ 8 /15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,500	2,440	303,626	2022/11/15
		1.75 T-NOTE 181031	1.75	1,200	1,222	152,103	2018/10/31
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,500	2,532	315,059	2019/ 9 /30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,800	1,807	224,883	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	700	693	86,304	2022/ 2 /28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,200	2,178	270,986	2022/ 3 /31
		1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,000	1,979	246,234	2022/ 4 /30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,900	2,868	356,871	2022/ 5 /15
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	3,500	3,427	426,454	2023/ 5 /15
		1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,900	1,943	241,818	2017/ 8 /31
		1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,738	216,330	2017/ 9 /30
1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,200	2,250	279,957	2017/10/31		
1.875 T-NOTE 200630	1.875	3,300	3,345	416,199	2020/ 6 /30		
1.875 T-NOTE 211130	1.875	300	300	37,360	2021/11/30		
2 T-NOTE 200731	2.0	1,600	1,630	202,866	2020/ 7 /31		
2 T-NOTE 201130	2.0	2,300	2,337	290,771	2020/11/30		

三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	2 T-NOTE 210228	2.0	800	811	100,920	2021/ 2 /28
		2 T-NOTE 210531	2.0	1,700	1,721	214,190	2021/ 5 /31
		2 T-NOTE 210831	2.0	2,300	2,324	289,251	2021/ 8 /31
		2 T-NOTE 211031	2.0	2,100	2,118	263,547	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	3,400	3,430	426,795	2021/11/15
		2 T-NOTE 220215	2.0	1,900	1,914	238,189	2022/ 2 /15
		2 T-NOTE 230215	2.0	3,400	3,399	422,961	2023/ 2 /15
		2 T-NOTE 250215	2.0	4,300	4,237	527,189	2025/ 2 /15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,500	2,560	318,631	2020/ 8 /31
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	102	12,702	2021/ 1 /31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,800	1,833	228,172	2021/ 6 /30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	2,700	2,747	341,865	2021/ 8 /15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,400	1,423	177,127	2021/ 9 /30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,300	2,334	290,458	2021/12/31
		2.125 T-NOTE 220630	2.125	2,300	2,330	289,899	2022/ 6 /30
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	3,700	3,684	458,447	2025/ 5 /15
		2.25 T-NOTE 171130	2.25	1,900	1,960	243,887	2017/11/30
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	1,200	1,241	154,424	2018/ 7 /31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,700	1,745	217,165	2021/ 3 /31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,600	1,643	204,422	2021/ 4 /30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,900	1,947	242,289	2021/ 7 /31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,100	4,130	513,947	2024/11/15
		2.375 T-NOTE 170731	2.375	2,100	2,167	269,692	2017/ 7 /31
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	300	311	38,735	2018/ 5 /31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	700	726	90,383	2018/ 6 /30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	2,400	2,483	308,965	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,100	4,177	519,766	2024/ 8 /15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	2,300	2,142	266,514	2045/ 2 /15
		2.5 T-NOTE 170630	2.5	1,800	1,860	231,523	2017/ 6 /30
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	2,800	2,893	360,024	2023/ 8 /15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,000	4,120	512,610	2024/ 5 /15
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,000	1,041	129,605	2018/ 1 /31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	800	834	103,886	2018/ 4 /30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,900	3,040	378,252	2020/ 8 /15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	1,200	1,256	156,355	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	3,200	3,154	392,451	2042/ 8 /15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	4,100	4,036	502,191	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 161130	2.75	2,600	2,677	333,108	2016/11/30
		2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,700	1,763	219,354	2017/ 5 /31
		2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,700	1,775	220,891	2017/12/31
		2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,000	1,045	130,101	2018/ 2 /28
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	2,100	2,207	274,652	2019/ 2 /15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	3,600	3,789	471,497	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,100	3,258	405,439	2024/ 2 /15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	3,900	3,931	489,218	2043/ 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	2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,100	1,154	143,635	2018/ 3 /31
		3 T-BOND 420515	3.0	1,000	1,036	128,959	2042/ 5 /15
		3 T-BOND 441115	3.0	2,300	2,374	295,376	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	2,100	2,171	270,222	2045/ 5 /15
		3 T-NOTE 160831	3.0	800	821	102,214	2016/ 8 /31
		3 T-NOTE 160930	3.0	2,500	2,572	320,029	2016/ 9 /30
		3 T-NOTE 170228	3.0	1,800	1,866	232,275	2017/ 2 /28
		3.125 T-BOND 411115	3.125	900	958	119,274	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	900	957	119,107	2042/ 2 /15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	4,100	4,337	539,732	2043/ 2 /15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	2,400	2,538	315,801	2044/ 8 /15
		3.125 T-NOTE 161031	3.125	2,400	2,477	308,196	2016/10/31
		3.125 T-NOTE 170131	3.125	2,200	2,282	283,977	2017/ 1 /31
		3.125 T-NOTE 170430	3.125	1,900	1,980	246,417	2017/ 4 /30
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	1,600	1,706	212,276	2019/ 5 /15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,900	2,040	253,887	2021/ 5 /15
		3.25 T-NOTE 161231	3.25	2,000	2,075	258,220	2016/12/31
		3.25 T-NOTE 170331	3.25	2,200	2,294	285,453	2017/ 3 /31
		3.375 T-BOND 440515	3.375	2,800	3,102	385,989	2044/ 5 /15
		3.375 T-NOTE 191115	3.375	2,800	3,022	376,109	2019/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	800	909	113,159	2039/ 2 /15
		3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,800	1,914	238,171	2018/ 2 /15
		3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,100	2,285	284,348	2020/ 5 /15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	200	231	28,855	2044/ 2 /15
		3.625 T-NOTE 190815	3.625	1,700	1,849	230,104	2019/ 8 /15
		3.625 T-NOTE 200215	3.625	2,400	2,622	326,229	2020/ 2 /15
		3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,200	3,521	438,176	2021/ 2 /15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	900	1,065	132,597	2041/ 8 /15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	500	593	73,845	2043/11/15
		3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,600	2,815	350,306	2018/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	1,300	1,565	194,815	2040/ 8 /15
		3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,600	1,724	214,616	2018/ 5 /15
		4 T-NOTE 180815	4.0	1,300	1,413	175,924	2018/ 8 /15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	500	634	78,982	2039/ 5 /15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	1,400	1,783	221,940	2040/11/15
		4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,800	1,937	241,076	2017/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	500	645	80,367	2038/ 2 /15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	1,100	1,422	177,001	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,400	1,813	225,641	2040/ 5 /15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	900	1,171	145,755	2041/ 5 /15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	500	657	81,835	2036/ 2 /15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	500	656	81,723	2038/ 5 /15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	1,000	1,315	163,660	2039/ 8 /15
		4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,500	1,601	199,263	2017/ 5 /15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	1,600	2,144	266,818	2040/ 2 /15

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	4.625 T-NOTE 161115	4.625	2,300	2,420	301,200	2016/11/15
		4.625 T-NOTE 170215	4.625	2,100	2,228	277,254	2017/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,300	1,780	221,490	2041/2/15
		4.75 T-NOTE 170815	4.75	1,800	1,945	242,021	2017/8/15
		4.875 T-NOTE 160815	4.875	1,100	1,149	143,015	2016/8/15
		5 T-BOND 370515	5.0	400	560	69,768	2037/5/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	600	802	99,812	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	500	670	83,414	2029/2/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	800	1,109	138,028	2031/2/15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	200	272	33,877	2028/8/15
		6 T-BOND 260215	6.0	600	817	101,695	2026/2/15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	400	565	70,417	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	300	394	49,057	2023/8/15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	600	890	110,788	2030/5/15
		6.5 T-BOND 261115	6.5	400	572	71,203	2026/11/15
		7.5 T-BOND 161115	7.5	1,500	1,633	203,200	2016/11/15
		8 T-BOND 211115	8.0	500	683	84,999	2021/11/15
		8.125 T-BOND 190815	8.125	500	632	78,642	2019/8/15
		8.75 T-BOND 170515	8.75	900	1,027	127,834	2017/5/15
		8.75 T-BOND 200815	8.75	700	941	117,148	2020/8/15
8.875 T-BOND 190215	8.875	600	759	94,440	2019/2/15		
小 計						49,527,536	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	600	599	56,672	2020/9/1
		1 CAN GOVT 160801	1.0	1,000	1,005	95,121	2016/8/1
		1.25 CAN GOVT 170801	1.25	200	203	19,220	2017/8/1
		1.25 CAN GOVT 180201	1.25	400	407	38,590	2018/2/1
		1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	816	77,235	2018/3/1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	600	614	58,144	2018/9/1
		1.5 CAN GOVT 170201	1.5	800	812	76,871	2017/2/1
		1.5 CAN GOVT 170301	1.5	1,400	1,423	134,662	2017/3/1
		1.5 CAN GOVT 170901	1.5	900	919	86,983	2017/9/1
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	600	623	58,958	2020/3/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	900	919	86,948	2023/6/1
		1.75 CAN GOVT 190301	1.75	600	627	59,332	2019/3/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	700	734	69,448	2019/9/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	800	859	81,338	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	850	933	88,288	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 160901	2.75	1,200	1,229	116,291	2016/9/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	800	888	84,015	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	300	345	32,667	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	200	241	22,804	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	905	85,670	2021/6/1
3.5 CAN GOVT 200601	3.5	800	904	85,582	2020/6/1		
3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,100	1,445	136,749	2045/12/1		

三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）

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	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,100	1,233	116,720	2019/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	1,100	1,170	110,762	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,000	1,376	130,255	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	800	884	83,707	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	850	1,286	121,755	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	700	1,038	98,237	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	800	1,253	118,612	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	300	505	47,810	2027/6/1
小 計						2,479,461	
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	14,700	18,859	145,219	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,100	5,701	43,903	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	12,500	12,486	96,147	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	5,200	5,267	40,560	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	5,800	5,731	44,129	2019/12/11
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	8,700	9,084	69,950	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	6,700	6,953	53,538	2022/6/9
		7.25 MEXICAN BONO 161215	7.25	7,200	7,513	57,852	2016/12/15
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,500	6,069	46,731	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	9,300	9,956	76,663	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	8,700	9,809	75,535	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	3,600	4,065	31,304	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	8,100	9,187	70,740	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	7,800	8,672	66,775	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	5,700	6,454	49,700	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	11,000	12,196	93,913	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,100	7,305	56,255	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	6,200	7,548	58,122	2038/11/18
小 計						1,177,045	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	800	801	109,207	2020/4/17
		0 SCHATS 160916	—	400	401	54,660	2016/9/16
		0 SCHATS 161216	—	100	100	13,674	2016/12/16
		0 SCHATS 170310	—	500	502	68,407	2017/3/10
		0 SCHATS 170616	—	1,000	1,004	136,910	2017/6/16
		0.25 OBL 180413	0.25	1,100	1,114	151,905	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	800	812	110,694	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	500	505	68,911	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	1,400	1,384	188,642	2025/2/15
		0.5 OBL 170407	0.5	1,500	1,518	206,960	2017/4/7
		0.5 OBL 171013	0.5	1,100	1,118	152,400	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,100	1,121	152,767	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,100	1,127	153,576	2019/4/12
		0.75 OBL 170224	0.75	1,200	1,218	166,083	2017/2/24
		1 BUND 240815	1.0	1,300	1,351	184,174	2024/8/15

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	1 BUND 250815	1.0	300	309	42,211	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,000	1,039	141,563	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,100	1,146	156,162	2019/2/22
		1.25 OBL 161014	1.25	1,300	1,323	180,295	2016/10/14
		1.5 BUND 220904	1.5	1,000	1,088	148,240	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,100	1,197	163,123	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	400	435	59,336	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,000	1,086	147,974	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,400	1,547	210,826	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,300	1,441	196,360	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,400	1,564	213,153	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,300	1,466	199,805	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	900	1,003	136,671	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	900	1,016	138,486	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,100	1,245	169,710	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,150	1,464	199,510	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	700	896	122,146	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,500	1,721	234,561	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,700	1,949	265,685	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,200	1,423	193,886	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	800	1,143	155,799	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,800	2,056	280,173	2019/7/4
		3.75 BUND 170104	3.75	1,500	1,585	216,003	2017/1/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,100	1,247	169,995	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	1,300	1,433	195,298	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,600	2,417	329,376	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	1,400	1,520	207,173	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,000	1,130	154,030	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	800	1,282	174,776	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	600	884	120,540	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,250	2,004	273,121	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	900	1,554	211,834	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,000	1,632	222,373	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	900	1,408	191,975	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,484	202,283	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	600	1,028	140,111	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	700	1,156	157,569	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	911	124,231	2018/1/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	400	406	55,374	2019/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	900	902	122,999	2022/4/15
		1.5 ITALY GOVT 161215	1.5	1,000	1,019	138,954	2016/12/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,300	1,346	183,466	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,000	970	132,291	2025/6/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,100	1,159	158,043	2021/12/15
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,500	1,610	219,406	2019/5/1

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	2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,300	1,374	187,274	2024/12/1
		2.75 ITALY GOVT 161115	2.75	1,000	1,034	140,937	2016/11/15
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	750	805	109,713	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,400	1,504	204,922	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,200	1,308	178,313	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,200	1,323	180,299	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,100	1,263	172,191	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 160801	3.75	1,100	1,140	155,330	2016/8/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,200	1,376	187,567	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,000	1,147	156,394	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,000	2,298	313,143	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,200	1,393	189,897	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 170201	4.0	1,700	1,799	245,163	2017/2/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,400	1,616	220,287	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,700	2,051	279,501	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,600	1,808	246,470	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,000	2,290	312,121	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,600	1,852	252,422	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	1,800	1,989	271,111	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	1,000	1,124	153,172	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	1,700	1,941	264,538	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,867	254,395	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,300	1,577	214,950	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,500	1,827	249,051	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,500	1,861	253,619	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 160915	4.75	1,000	1,051	143,307	2016/9/15
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	900	972	132,526	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,400	1,518	206,830	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,000	2,416	329,248	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,600	1,975	269,121	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,300	1,668	227,366	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	950	1,299	177,038	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,300	1,603	218,474	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,400	1,785	243,253	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,000	2,716	370,095	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,100	1,525	207,884	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,300	1,802	245,610	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	2,000	2,203	300,254	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,800	2,440	332,571	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,200	1,529	208,356	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,100	1,401	190,993	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,000	1,457	198,598	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,600	2,358	321,375	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,200	1,749	238,342	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	700	1,064	144,993	2026/11/1

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	9 ITALY GOVT 231101	9.0	800	1,249	170,181	2023/11/ 1
フランス	国債証券	0 O. A. T 200525	—	900	893	121,711	2020/ 5 /25
		0.25 O. A. T 161125	0.25	700	704	95,928	2016/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,500	1,528	208,227	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,700	1,626	221,607	2025/ 5 /25
		1 BTAN 170725	1.0	1,700	1,739	237,056	2017/ 7 /25
		1 O. A. T 180525	1.0	1,700	1,754	239,002	2018/ 5 /25
		1 O. A. T 181125	1.0	1,400	1,449	197,550	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	1,400	1,453	198,093	2019/ 5 /25
		1.75 BTAN 170225	1.75	1,800	1,854	252,632	2017/ 2 /25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,900	2,062	280,982	2023/ 5 /25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	2,000	2,156	293,836	2024/11/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,500	1,683	229,359	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	2,000	2,249	306,535	2024/ 5 /25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	2,300	2,573	350,666	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,600	1,825	248,683	2030/ 5 /25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	2,400	2,807	382,524	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	2,300	2,689	366,476	2022/ 4 /25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	2,400	2,824	384,895	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,000	1,293	176,266	2045/ 5 /25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	2,600	3,012	410,487	2020/ 4 /25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	2,000	2,494	339,862	2026/ 4 /25
		3.75 O. A. T 170425	3.75	2,700	2,882	392,724	2017/ 4 /25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	2,500	2,890	393,847	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	2,300	2,751	374,953	2021/ 4 /25
		4 O. A. T 180425	4.0	1,800	2,001	272,767	2018/ 4 /25
		4 O. A. T 381025	4.0	1,600	2,270	309,407	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	900	1,372	187,064	2055/ 4 /25
		4 O. A. T 600425	4.0	700	1,083	147,616	2060/ 4 /25
		4.25 O. A. T 171025	4.25	2,400	2,635	359,046	2017/10/25
		4.25 O. A. T 181025	4.25	1,800	2,051	279,560	2018/10/25
		4.25 O. A. T 190425	4.25	1,600	1,854	252,716	2019/ 4 /25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	2,400	3,085	420,423	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	1,500	2,317	315,810	2041/ 4 /25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	1,500	2,277	310,302	2035/ 4 /25
		5 O. A. T 161025	5.0	1,600	1,700	231,690	2016/10/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	1,900	2,889	393,710	2029/ 4 /25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	1,550	2,537	345,756	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	1,200	1,787	243,590	2025/10/25
		8.5 O. A. T 191025	8.5	700	950	129,504	2019/10/25
		8.5 O. A. T 230425	8.5	600	960	130,906	2023/ 4 /25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	300	301	41,046	2018/ 4 /15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	500	505	68,823	2020/ 1 /15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	400	377	51,469	2025/ 7 /15
		0.5 NETH GOVT 170415	0.5	500	506	68,952	2017/ 4 /15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,100	1,138	155,135	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	700	732	99,762	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	900	984	134,084	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,200	1,336	182,139	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,000	1,128	153,744	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	1,000	1,039	141,563	2017/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	600	717	97,764	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	550	719	98,014	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,000	1,178	160,516	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	900	1,051	143,256	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	800	992	135,230	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,000	1,517	206,786	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,000	1,121	152,831	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,400	1,622	221,126	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	850	1,272	173,435	2037/1/15
		4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,400	1,527	208,146	2017/7/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	900	1,370	186,678	2028/1/15
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	600	604	82,322	2017/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,500	1,542	210,138	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,100	1,071	145,940	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	500	470	64,109	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	1,500	1,552	211,528	2017/4/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	400	406	55,322	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,100	1,189	162,044	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,400	1,502	204,770	2024/10/31
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,300	1,438	195,935	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	1,400	1,477	201,336	2017/1/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,300	1,506	205,234	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,600	1,833	249,817	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,400	1,554	211,751	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,100	1,349	183,844	2037/1/31
		4.25 SPAIN GOVT 161031	4.25	1,400	1,472	200,649	2016/10/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,300	1,497	204,048	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,300	1,566	213,435	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,500	1,656	225,711	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,100	1,273	173,480	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,200	1,489	202,985	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	750	987	134,524	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	900	1,114	151,834	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,200	1,436	195,783	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	800	1,080	147,166	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	900	1,183	161,288	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	650	922	125,696	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,100	1,394	190,011	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	1,500	1,658	226,008	2017/7/30

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,400	1,738	236,921	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,100	1,582	215,677	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,500	1,919	261,518	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	900	1,231	167,836	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,400	1,983	270,197	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	500	491	66,898	2025/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	700	727	99,151	2018/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	900	1,010	137,634	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,100	1,267	172,760	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	700	785	107,048	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	400	487	66,416	2034/6/22
		3.25 BEL GOVT 160928	3.25	700	727	99,104	2016/9/28
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	900	962	131,141	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,300	1,537	209,503	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	450	635	86,527	2045/6/22
		4 BEL GOVT 170328	4.0	800	854	116,471	2017/3/28
		4 BEL GOVT 180328	4.0	700	776	105,851	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	800	917	125,023	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	900	1,111	151,429	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	400	543	74,038	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	900	1,114	151,871	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,000	1,262	172,042	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	950	1,421	193,696	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	500	674	91,880	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,450	2,254	307,140	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 170928	5.5	500	560	76,415	2017/9/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,200	1,793	244,375	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	100	101	13,769	2019/10/18
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	300	307	41,958	2025/10/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	600	647	88,191	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	300	327	44,582	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	600	646	88,057	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	200	232	31,618	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	350	472	64,337	2044/6/20
		3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	600	631	86,013	2017/2/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	800	967	131,862	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	900	1,075	146,530	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	729	99,420	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	250	415	56,635	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	800	949	129,410	2020/7/15
		4 AUSTRIA GOVT 160915	4.0	700	732	99,776	2016/9/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	800	1,190	162,257	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	500	547	74,552	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,300	1,506	205,279	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	800	894	121,823	2018/1/15

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	500	697	95,027	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	400	633	86,289	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	300	303	41,396	2020/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	200	185	25,271	2031/4/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	400	415	56,622	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	200	214	29,198	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	324	44,194	2022/9/15
		1.875 FINNISH GOV 170415	1.875	400	414	56,421	2017/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	300	333	45,405	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	250	317	43,291	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	360	49,121	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	400	461	62,920	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	400	473	64,568	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	300	325	44,384	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	350	455	62,055	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	300	351	47,911	2019/7/4
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	202	27,536	2022/3/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	350	330	45,047	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	300	327	44,578	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	500	594	81,027	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	300	366	49,889	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	400	466	63,566	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	600	686	93,517	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	700	837	114,082	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	600	741	101,096	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	800	1,099	149,738	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	400	448	61,132	2017/10/18
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	500	618	84,287	2019/10/18		
小 計						46,490,363	
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	1,600	1,608	309,907	2017/9/7
		1.25 GILT 180722	1.25	2,100	2,116	407,865	2018/7/22
		1.75 GILT 170122	1.75	1,000	1,016	195,917	2017/1/22
		1.75 GILT 190722	1.75	1,700	1,733	333,960	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	1,700	1,709	329,358	2022/9/7
		2 GILT 200722	2.0	2,000	2,053	395,765	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	500	501	96,600	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	1,400	1,450	279,437	2023/9/7
		2.75 GILT 240907	2.75	1,400	1,503	289,620	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	1,550	1,797	346,426	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,100	1,336	257,477	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,250	1,684	324,514	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	1,200	1,320	254,477	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	1,100	1,227	236,450	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	1,400	1,581	304,646	2021/9/7

三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	3.75 GILT 520722	3.75	850	1,130	217,909	2052/ 7 /22
4 GILT 160907		4.0	1,500	1,555	299,758	2016/ 9 / 7	
4 GILT 220307		4.0	800	922	177,721	2022/ 3 / 7	
4 GILT 600122		4.0	800	1,163	224,198	2060/ 1 /22	
4.25 GILT 271207		4.25	800	990	190,886	2027/12/ 7	
4.25 GILT 320607		4.25	1,100	1,398	269,569	2032/ 6 / 7	
4.25 GILT 360307		4.25	1,200	1,559	300,515	2036/ 3 / 7	
4.25 GILT 390907		4.25	800	1,063	204,975	2039/ 9 / 7	
4.25 GILT 401207		4.25	1,100	1,474	284,173	2040/12/ 7	
4.25 GILT 461207		4.25	1,050	1,468	283,021	2046/12/ 7	
4.25 GILT 491207		4.25	950	1,361	262,336	2049/12/ 7	
4.25 GILT 551207		4.25	950	1,417	273,182	2055/12/ 7	
4.5 GILT 190307		4.5	900	1,008	194,309	2019/ 3 / 7	
4.5 GILT 340907		4.5	1,400	1,858	358,208	2034/ 9 / 7	
4.5 GILT 421207		4.5	1,300	1,833	353,388	2042/12/ 7	
4.75 GILT 200307		4.75	1,200	1,383	266,652	2020/ 3 / 7	
4.75 GILT 301207		4.75	1,300	1,726	332,722	2030/12/ 7	
4.75 GILT 381207		4.75	1,100	1,557	300,123	2038/12/ 7	
5 GILT 180307		5.0	1,100	1,218	234,818	2018/ 3 / 7	
5 GILT 250307		5.0	1,200	1,530	294,919	2025/ 3 / 7	
6 GILT 281207	6.0	700	1,022	196,976	2028/12/ 7		
8 GILT 210607	8.0	800	1,090	210,163	2021/ 6 / 7		
8.75 GILT 170825	8.75	500	582	112,328	2017/ 8 /25		
小 計						10,205,289	
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	250	286	36,203	2021/ 4 /28
2.25 SWISS GOVT 200706		2.25	270	308	38,995	2020/ 7 / 6	
3 SWISS GOVT 180108		3.0	390	426	53,892	2018/ 1 / 8	
3 SWISS GOVT 190512		3.0	360	411	51,948	2019/ 5 /12	
4 SWISS GOVT 230211		4.0	270	358	45,268	2023/ 2 /11	
4 SWISS GOVT 280408		4.0	380	565	71,466	2028/ 4 / 8	
4.25 SWISS GOVT 170605		4.25	300	327	41,438	2017/ 6 / 5	
小 計						339,213	
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	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	4,200	4,517	63,974	2023/11/13
2.5 SWD GOVT 250512		2.5	3,400	3,971	56,230	2025/ 5 /12	
3.5 SWD GOVT 220601		3.5	4,900	5,936	84,061	2022/ 6 / 1	
3.5 SWD GOVT 390330		3.5	2,700	3,669	51,962	2039/ 3 /30	
3.75 SWD GOVT 170812		3.75	3,800	4,123	58,395	2017/ 8 /12	
4.25 SWD GOVT 190312		4.25	5,200	6,039	85,519	2019/ 3 /12	
5 SWD GOVT 201201		5.0	5,300	6,677	94,551	2020/12/ 1	
小 計						494,694	
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	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,400	1,428	21,491	2025/ 3 /13
2 NORWE GOVT 230524		2.0	3,100	3,249	48,910	2023/ 5 /24	

銘 柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
ノルウェー			%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円		
	国債証券	3 NORWE GOVT 240314	3.0	2,900	3,267	49,174	2024/ 3 /14	
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,400	5,051	76,027	2021/ 5 /25	
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	3,900	4,144	62,375	2017/ 5 /19	
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	4,000	4,549	68,465	2019/ 5 /22	
小 計						326,444		
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	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,800	4,078	74,481	2023/11/15	
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,900	3,154	57,600	2025/11/15	
		2.5 DMK GOVT 161115	2.5	3,300	3,412	62,312	2016/11/15	
		3 DMK GOVT 211115	3.0	5,700	6,663	121,671	2021/11/15	
		4 DMK GOVT 171115	4.0	3,300	3,610	65,931	2017/11/15	
		4 DMK GOVT 191115	4.0	6,100	7,129	130,187	2019/11/15	
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	7,700	12,640	230,810	2039/11/15	
		7 DMK GOVT 241110	7.0	1,800	2,838	51,839	2024/11/10	
小 計						794,835		
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	900	860	28,013	2020/ 4 /25	
		2.5 POLAND 180725	2.5	1,500	1,518	49,423	2018/ 7 /25	
		3.25 POLAND 190725	3.25	1,600	1,657	53,947	2019/ 7 /25	
		3.25 POLAND 250725	3.25	1,600	1,629	53,027	2025/ 7 /25	
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,400	1,463	47,629	2018/ 4 /25	
		4 POLAND 231025	4.0	1,700	1,832	59,662	2023/10/25	
		4.75 POLAND 161025	4.75	1,500	1,553	50,572	2016/10/25	
		4.75 POLAND 170425	4.75	1,100	1,154	37,580	2017/ 4 /25	
		5.25 POLAND 171025	5.25	1,500	1,607	52,325	2017/10/25	
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,100	1,243	40,490	2020/10/25	
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,300	1,463	47,648	2019/10/25	
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,000	1,172	38,176	2021/10/25	
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,400	1,662	54,118	2022/ 9 /23	
		5.75 POLAND 290425	5.75	600	762	24,813	2029/ 4 /25	
小 計						637,430		
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	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	700	717	66,070	2019/10/21	
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,500	1,498	137,937	2024/ 4 /21	
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	250	224	20,689	2035/ 6 /21	
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	600	623	57,350	2018/10/21	
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,200	1,240	114,157	2025/ 4 /21	
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	700	706	65,049	2029/ 4 /21	
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	450	468	43,129	2037/ 4 /21	
		4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,100	1,147	105,590	2017/ 7 /21	
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,100	1,232	113,406	2026/ 4 /21	
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,200	1,324	121,867	2020/ 4 /15	
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	650	751	69,192	2033/ 4 /21	
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,000	1,171	107,806	2027/ 4 /21	
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,700	1,889	173,871	2019/ 3 /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	
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	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,200	1,300	119,713	2018/1/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,400	1,677	154,357	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,700	2,010	185,027	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,100	1,323	121,777	2022/7/15
	6 AUST GOVT 170215	6.0	1,300	1,377	126,752	2017/2/15
小 計					1,903,745	
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	200	196	17,656	2018/4/1
	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	150	149	13,399	2019/10/1
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	150	149	13,443	2020/7/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	300	300	26,983	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 170401	2.375	300	306	27,549	2017/4/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	100	97	8,800	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	400	412	37,019	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	200	204	18,344	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	330	318	28,570	2042/4/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	99	8,969	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	200	198	17,818	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	450	467	41,950	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	300	314	28,263	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	300	316	28,438	2020/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	160	170	15,267	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	360	388	34,901	2027/3/1
	3.75 SINGAPORGOVT 160901	3.75	500	514	46,243	2016/9/1
	4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	250	269	24,244	2018/9/1
小 計					437,863	
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	600	596	18,901	2018/3/1
	3.314 MALAYSIA 171031	3.314	600	599	19,019	2017/10/31
	3.394 MALAYSIAGOV 170315	3.394	600	601	19,055	2017/3/15
	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	500	477	15,139	2022/8/15
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,100	1,050	33,316	2023/3/15
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	700	688	21,837	2020/3/31
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	900	832	26,385	2027/5/31
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	600	599	18,992	2018/9/28
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	500	497	15,776	2019/10/31
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	93	2,971	2028/6/15
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	300	295	9,354	2022/9/30
	3.814MALAYSIAGOV 170215	3.814	900	906	28,750	2017/2/15
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	200	185	5,894	2033/4/15
	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	700	700	22,197	2020/7/31
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	800	769	24,406	2027/3/15
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,000	1,013	32,136	2017/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	800	800	25,360	2021/9/30
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	500	480	15,246	2032/4/15

三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
マレーシア			%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
	国債証券	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	800	804	25,512	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	600	599	19,004	2024/7/15
		4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,000	1,017	32,259	2018/2/7
		4.262MALAYSIAGOV 160915	4.262	700	707	22,432	2016/9/15
		4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,400	1,431	45,373	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	600	608	19,274	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	600	609	19,326	2030/4/15
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	400	413	13,111	2043/9/30
		5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	300	321	10,202	2019/7/30
小 計						561,240	
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	9,500	11,115	109,377	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	5,400	4,139	40,730	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	5,000	3,860	37,990	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	4,000	3,804	37,432	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	5,500	4,756	46,806	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	4,900	4,815	47,381	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	3,500	3,442	33,869	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	2,900	2,941	28,941	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,600	4,389	43,194	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	3,900	3,978	39,146	2017/9/15
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,000	2,896	28,500	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	3,700	3,605	35,477	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	2,500	2,483	24,433	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	5,700	5,662	55,718	2048/2/28
小 計						609,000	
合 計						115,984,166	

（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。

三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

《第15期》決算日2015年5月20日

[計算期間：2014年5月21日～2015年5月20日]

「三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド」は、5月20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	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（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○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、円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 率	円	騰 落 率			
11期(2011年5月20日)	17,226	△ 1.8	292.5904	△ 1.4	98.7	—	百万円 217,756
12期(2012年5月21日)	17,164	△ 0.4	291.3347	△ 0.4	98.8	—	204,958
13期(2013年5月20日)	23,300	35.7	396.6181	36.1	98.9	—	238,488
14期(2014年5月20日)	24,305	4.3	412.1913	3.9	98.7	—	174,867
15期(2015年5月20日)	27,492	13.1	466.3665	13.1	98.8	—	128,186

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）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。

(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	騰 落 率	シティ世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2014年5月20日	円 24,305	% —	412.1913	% —	% 98.7	% —
5月末	24,361	0.2	413.8182	0.4	98.6	—
6月末	24,451	0.6	415.5816	0.8	98.7	—
7月末	24,685	1.6	419.3546	1.7	98.8	—
8月末	25,087	3.2	426.4201	3.5	98.8	—
9月末	25,795	6.1	438.1378	6.3	98.6	—
10月末	25,850	6.4	438.2998	6.3	98.7	—
11月末	28,041	15.4	475.7084	15.4	98.6	—
12月末	28,339	16.6	482.5458	17.1	97.8	—
2015年1月末	27,501	13.1	467.2651	13.4	98.6	—
2月末	27,572	13.4	469.4314	13.9	98.6	—
3月末	27,460	13.0	465.9620	13.0	98.6	—
4月末	27,451	12.9	467.4672	13.4	98.6	—
(期 末) 2015年5月20日	27,492	13.1	466.3665	13.1	98.8	—

(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13.1%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(13.1%)とほぼ同程度となりました。

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

債券市況の推移

(期首を100として指数化)



◎外国債券市況

- ・世界経済の先行き不透明感の高まりや先進国のインフレ期待の低下などに加え、ＥＣＢ（欧州中央銀行）による追加緩和策の発表および実施などを背景に、金利は総じて低下（債券価格は上昇）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・ドル相場は、日銀による追加金融緩和策の発表・実施や、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による利上げ観測の高まりなどから、ドルが対円で買われました。期首との比較では、ドルは対円で19.2%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、ＥＣＢによる追加緩和策の発表・実施や、ギリシャの情勢不安などを背景に、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3.3%下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)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。

●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13.1%の上昇となったため、カイ離は△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 とのカイ離	△0.0%程度	△0.0%程度	0.0%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0.0%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、当ファンドの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

(2014年 5 月21日～2015年 5 月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 7	% 0.027	(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)	(7)	(0.027)	外国での資産の保管等に要する費用
(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	7	0.027	
期中の平均基準価額は、26,382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

(2014年5月21日～2015年5月20日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 108,149	千アメリカドル 326,349
	カナダ	国債証券	千カナダドル 6,279	千カナダドル 20,711
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 39,714	千メキシコペソ 108,779
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	13,309	54,261
	イタリア	国債証券	16,037	60,604
	フランス	国債証券	15,165	61,874
	オランダ	国債証券	3,076	15,205
	スペイン	国債証券	11,083	33,949
	ベルギー	国債証券	3,519	16,250
	オーストリア	国債証券	1,491	9,571
	フィンランド	国債証券	1,141	4,638
	アイルランド	国債証券	1,747	5,447
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 10,611	千イギリスポンド 39,032
	スイス	国債証券	千スイスフラン 222	千スイスフラン 3,260
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 6,244	千スウェーデンクローネ 29,623
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 5,325	千ノルウェークローネ 20,164
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 7,055	千デンマーククローネ 38,402
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 6,062	千ポーランドズロチ 19,331
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 5,369	千オーストラリアドル 12,574
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 1,510	千シンガポールドル 4,083
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングgit 4,115	千マレーシアリングgit 12,564
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 15,145	千南アフリカランド 38,458

(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

(2014年5月21日～2015年5月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 8,637	百万円 3,788	% 43.9	百万円 76,031	百万円 52,878	% 69.5

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2015年5月20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
アメリカ	千アメリカドル 426,200	千アメリカドル 438,710	千円 53,057,673	% 41.4	% —	% 15.6	% 15.2	% 10.7
カナダ	千カナダドル 26,600	千カナダドル 29,614	2,926,529	2.3	—	1.1	0.7	0.6
メキシコ	千メキシコペソ 155,100	千メキシコペソ 173,045	1,375,710	1.1	—	0.7	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	60,650	71,985	9,685,711	7.6	—	4.4	2.1	1.1
イタリア	77,650	92,841	12,491,832	9.7	—	5.9	2.8	1.0
フランス	74,600	90,212	12,138,060	9.5	—	5.8	2.6	1.1
オランダ	20,400	24,057	3,236,956	2.5	—	1.5	0.7	0.3
スペイン	43,300	51,172	6,885,230	5.4	—	3.0	1.6	0.8
ベルギー	19,350	24,290	3,268,336	2.5	—	1.8	0.6	0.2
オーストリア	12,350	15,147	2,038,031	1.6	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	4,900	5,562	748,467	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	6,200	7,403	996,112	0.8	—	0.4	0.4	—
イギリス	千イギリスポンド 48,350	千イギリスポンド 57,138	10,711,831	8.4	—	6.1	1.8	0.4
スイス	千スイスフラン 2,520	千スイスフラン 3,048	393,049	0.3	—	0.2	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 37,400	千スウェーデンクローネ 43,860	635,098	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 21,600	千ノルウェークローネ 23,602	378,110	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 38,600	千デンマーククローネ 48,962	883,285	0.7	—	0.5	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 20,600	千ポーランドズロチ 22,357	742,499	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 21,400	千オーストラリアドル 23,327	2,230,824	1.7	—	0.9	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 4,910	千シンガポールドル 5,123	463,963	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 20,100	千マレーシアリンギット 20,179	675,612	0.5	—	0.2	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 69,600	千南アフリカランド 67,709	687,254	0.5	—	0.4	0.1	—
合 計	—	—	126,650,183	98.8	—	50.7	31.1	17.0

(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 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	0.25 T-NOTE 160515	0.25	1,900	1,899	229,777	2016/ 5 /15	
	0. 5 T-NOTE 160615	0. 5	3,500	3,506	424,133	2016/ 6 /15	
	0. 5 T-NOTE 170731	0. 5	2,500	2,487	300,838	2017/ 7 /31	
	0.625 T-NOTE 160715	0.625	3,000	3,009	363,967	2016/ 7 /15	
	0.625 T-NOTE 160815	0.625	3,100	3,109	376,012	2016/ 8 /15	
	0.625 T-NOTE 161015	0.625	2,600	2,605	315,168	2016/10/15	
	0.625 T-NOTE 161115	0.625	3,000	3,006	363,571	2016/11/15	
	0.625 T-NOTE 170215	0.625	2,700	2,702	326,882	2017/ 2 /15	
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	4,000	3,997	483,400	2017/ 5 /31	
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	3,500	3,489	422,000	2017/ 8 /31	
	0.625 T-NOTE 170930	0.625	3,000	2,988	361,388	2017/ 9 /30	
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	1,400	1,392	168,356	2017/11/30	
	0.75 T-NOTE 170315	0.75	2,900	2,909	351,835	2017/ 3 /15	
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	3,300	3,303	399,585	2017/ 6 /30	
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	3,000	2,994	362,153	2017/10/31	
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	2,700	2,690	325,441	2017/12/31	
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	1,500	1,492	180,446	2018/ 2 /28	
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	400	397	48,081	2018/ 3 /31	
	0.875 T-NOTE 160915	0.875	3,900	3,923	474,448	2016/ 9 /15	
	0.875 T-NOTE 161130	0.875	3,100	3,117	377,066	2016/11/30	
	0.875 T-NOTE 161231	0.875	3,400	3,420	413,621	2016/12/31	
	0.875 T-NOTE 170131	0.875	3,600	3,619	437,782	2017/ 1 /31	
	0.875 T-NOTE 170228	0.875	3,300	3,317	401,237	2017/ 2 /28	
	0.875 T-NOTE 170415	0.875	1,500	1,507	182,324	2017/ 4 /15	
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	2,900	2,914	352,465	2017/ 4 /30	
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	3,000	3,014	364,534	2017/ 5 /15	
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	3,500	3,514	425,026	2017/ 6 /15	
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	1,300	1,303	157,682	2017/ 8 /15	
	0.875 T-NOTE 171015	0.875	1,300	1,302	157,473	2017/10/15	
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	1,400	1,398	169,157	2018/ 1 /31	
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	1,200	1,173	141,919	2019/ 7 /31	
	1 T-NOTE 160831	1. 0	3,700	3,728	450,886	2016/ 8 /31	
	1 T-NOTE 160930	1. 0	4,500	4,534	548,418	2016/ 9 /30	
	1 T-NOTE 161031	1. 0	3,300	3,325	402,157	2016/10/31	
	1 T-NOTE 170331	1. 0	3,500	3,526	426,530	2017/ 3 /31	
	1 T-NOTE 170915	1. 0	2,000	2,010	243,117	2017/ 9 /15	
1 T-NOTE 180315	1. 0	500	500	60,543	2018/ 3 /15		
1 T-NOTE 190831	1. 0	2,400	2,355	284,847	2019/ 8 /31		
1 T-NOTE 190930	1. 0	1,000	980	118,549	2019/ 9 /30		
1 T-NOTE 191130	1. 0	2,500	2,443	295,535	2019/11/30		
1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,200	1,188	143,795	2019/ 5 /31		
1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,900	1,865	225,585	2019/12/31		
1.125 T-NOTE 200331	1.125	1,400	1,369	165,651	2020/ 3 /31		
1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,900	2,903	351,137	2018/11/30		

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	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,400	2,398	290,029	2019/ 1 /31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	800	797	96,449	2019/ 4 /30
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	1,500	1,485	179,638	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	3,200	3,157	381,837	2020/ 1 /31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	100	98	11,915	2020/ 2 /29
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,800	1,817	219,766	2018/ 6 /30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,200	2,219	268,437	2018/ 7 /31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	4,000	4,029	487,312	2018/ 9 /30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,100	1,106	133,834	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,400	1,406	170,096	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,700	1,704	206,160	2019/ 2 /28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,900	1,885	228,044	2020/ 1 /31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,900	2,875	347,766	2020/ 2 /29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,500	2,476	299,491	2020/ 3 /31
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,900	1,878	227,218	2020/ 5 /31
		1.5 T-NOTE 160630	1.5	2,800	2,836	343,036	2016/ 6 /30
		1.5 T-NOTE 160731	1.5	4,600	4,662	563,886	2016/ 7 /31
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	2,900	2,934	354,918	2018/ 8 /31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	3,100	3,127	378,282	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,600	2,621	317,023	2019/ 1 /31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,200	2,216	268,084	2019/ 2 /28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	900	906	109,577	2019/ 3 /31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,000	2,009	243,070	2019/ 5 /31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	2,900	2,900	350,835	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	500	499	60,467	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,700	2,619	316,818	2022/ 1 /31
		1.625 T-NOTE 190331	1.625	2,300	2,325	281,291	2019/ 3 /31
		1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,500	1,515	183,323	2019/ 4 /30
		1.625 T-NOTE 190630	1.625	3,400	3,430	414,922	2019/ 6 /30
		1.625 T-NOTE 190731	1.625	2,000	2,016	243,864	2019/ 7 /31
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	500	502	60,725	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,800	1,751	211,858	2022/ 8 /15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,700	2,620	316,945	2022/11/15
		1.75 T-NOTE 160531	1.75	2,700	2,740	331,397	2016/ 5 /31
		1.75 T-NOTE 181031	1.75	1,200	1,223	147,951	2018/10/31
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	3,700	3,743	452,791	2019/ 9 /30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,800	1,802	217,998	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	700	689	83,407	2022/ 2 /28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,200	2,165	261,952	2022/ 3 /31
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,300	1,279	154,759	2022/ 5 /15
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	3,700	3,599	435,382	2023/ 5 /15
		1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,900	1,948	235,629	2017/ 8 /31
		1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,743	210,874	2017/ 9 /30
		1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,200	2,256	272,844	2017/10/31
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	300	298	36,128	2021/11/30

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	2 T-NOTE 200731	2.0	1,600	1,627	196,875	2020/ 7 /31
		2 T-NOTE 201130	2.0	2,300	2,331	281,964	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	800	809	97,855	2021/ 2 /28
		2 T-NOTE 210531	2.0	2,000	2,017	243,949	2021/ 5 /31
		2 T-NOTE 210831	2.0	3,400	3,418	413,476	2021/ 8 /31
		2 T-NOTE 211031	2.0	2,800	2,810	339,954	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	3,600	3,615	437,254	2021/11/15
		2 T-NOTE 220215	2.0	1,900	1,904	230,378	2022/ 2 /15
		2 T-NOTE 230215	2.0	3,900	3,880	469,344	2023/ 2 /15
		2 T-NOTE 250215	2.0	4,500	4,394	531,474	2025/ 2 /15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,500	2,556	309,176	2020/ 8 /31
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	101	12,316	2021/ 1 /31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,900	1,928	233,178	2021/ 6 /30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,700	3,749	453,473	2021/ 8 /15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,400	1,417	171,379	2021/ 9 /30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,300	2,324	281,095	2021/12/31
		2.25 T-NOTE 171130	2.25	1,900	1,966	237,819	2017/11/30
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	1,500	1,554	188,014	2018/ 7 /31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,843	222,930	2021/ 3 /31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,000	2,046	247,549	2021/ 4 /30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,200	2,246	271,701	2021/ 7 /31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,800	4,797	580,149	2024/11/15
		2.375 T-NOTE 170731	2.375	2,100	2,175	263,130	2017/ 7 /31
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,000	1,040	125,815	2018/ 5 /31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	900	936	113,225	2018/ 6 /30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	2,400	2,479	299,825	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,700	4,755	575,123	2024/ 8 /15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	2,300	2,051	248,085	2045/ 2 /15
		2.5 T-NOTE 170630	2.5	1,800	1,868	226,017	2017/ 6 /30
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	2,800	2,880	348,341	2023/ 8 /15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,500	4,605	557,027	2024/ 5 /15
		2.625 T-NOTE 160430	2.625	200	204	24,726	2016/ 4 /30
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,000	1,046	126,509	2018/ 1 /31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	800	837	101,343	2018/ 4 /30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	3,100	3,249	393,000	2020/ 8 /15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	5,000	5,233	632,998	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	4,100	3,866	467,652	2042/ 8 /15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	4,500	4,242	513,106	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 161130	2.75	2,600	2,688	325,191	2016/11/30
		2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,700	1,771	214,263	2017/ 5 /31
		2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,700	1,782	215,580	2017/12/31
		2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,000	1,050	127,010	2018/ 2 /28
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	2,300	2,424	293,210	2019/ 2 /15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	3,800	3,977	481,042	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,400	3,553	429,764	2024/ 2 /15

銘		柄	当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,100	3,960	478,963	2043/ 5 /15
		2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,100	1,159	140,194	2018/ 3 /31
		3 T-BOND 420515	3.0	1,800	1,786	216,059	2042/ 5 /15
		3 T-BOND 441115	3.0	2,600	2,574	311,397	2044/11/15
		3 T-NOTE 160831	3.0	800	826	99,975	2016/ 8 /31
		3 T-NOTE 160930	3.0	2,500	2,587	312,896	2016/ 9 /30
		3 T-NOTE 170228	3.0	1,800	1,877	227,088	2017/ 2 /28
		3.125 T-BOND 411115	3.125	1,000	1,019	123,321	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	900	916	110,784	2042/ 2 /15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	4,200	4,259	515,091	2043/ 2 /15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	2,400	2,434	294,428	2044/ 8 /15
		3.125 T-NOTE 161031	3.125	2,400	2,491	301,310	2016/10/31
		3.125 T-NOTE 170131	3.125	2,200	2,295	277,656	2017/ 1 /31
		3.125 T-NOTE 170430	3.125	1,900	1,991	240,835	2017/ 4 /30
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,300	2,457	297,263	2019/ 5 /15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,100	2,252	272,456	2021/ 5 /15
		3.25 T-NOTE 160531	3.25	1,900	1,957	236,787	2016/ 5 /31
		3.25 T-NOTE 160630	3.25	2,400	2,478	299,689	2016/ 6 /30
		3.25 T-NOTE 160731	3.25	3,000	3,103	375,376	2016/ 7 /31
		3.25 T-NOTE 161231	3.25	2,000	2,087	252,415	2016/12/31
		3.25 T-NOTE 170331	3.25	2,200	2,308	279,163	2017/ 3 /31
		3.375 T-BOND 440515	3.375	2,900	3,084	373,084	2044/ 5 /15
		3.375 T-NOTE 191115	3.375	2,800	3,028	366,304	2019/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	800	870	105,229	2039/ 2 /15
		3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,800	1,925	232,870	2018/ 2 /15
		3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,100	2,290	277,030	2020/ 5 /15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	200	222	26,924	2044/ 2 /15
		3.625 T-NOTE 190815	3.625	3,000	3,271	395,643	2019/ 8 /15
		3.625 T-NOTE 200215	3.625	2,400	2,628	317,852	2020/ 2 /15
		3.625 T-NOTE 210215	3.625	4,100	4,514	545,943	2021/ 2 /15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	1,200	1,363	164,867	2041/ 8 /15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	500	568	68,803	2043/11/15
		3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,600	2,827	341,982	2018/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	1,300	1,500	181,444	2040/ 8 /15
		3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,100	1,193	144,326	2018/ 5 /15
		4 T-NOTE 180815	4.0	1,300	1,422	171,998	2018/ 8 /15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	1,000	1,217	147,301	2039/ 5 /15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	1,400	1,712	207,094	2040/11/15
		4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,800	1,951	235,983	2017/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	500	620	75,100	2038/ 2 /15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	1,100	1,366	165,211	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,500	1,866	225,685	2040/ 5 /15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,200	1,500	181,444	2041/ 5 /15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	500	633	76,645	2036/ 2 /15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	500	631	76,324	2038/ 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	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,000	1,263	152,837	2039/ 8 /15
		4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,500	1,614	195,214	2017/ 5 /15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	1,800	2,318	280,414	2040/ 2 /15
		4.625 T-NOTE 161115	4.625	2,300	2,442	295,362	2016/11/15
		4.625 T-NOTE 170215	4.625	2,100	2,249	272,020	2017/ 2 /15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,600	2,108	255,001	2041/ 2 /15
		4.75 T-NOTE 170815	4.75	1,800	1,960	237,139	2017/ 8 /15
		4.875 T-NOTE 160815	4.875	1,700	1,794	217,026	2016/ 8 /15
		5 T-BOND 370515	5.0	500	675	81,747	2037/ 5 /15
		5.125 T-NOTE 160515	5.125	1,500	1,571	190,041	2016/ 5 /15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	600	786	95,087	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	400	525	63,501	2029/ 2 /15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	900	1,217	147,214	2031/ 2 /15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	400	535	64,702	2028/ 8 /15
		6 T-BOND 260215	6.0	600	810	98,040	2026/ 2 /15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	600	837	101,340	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	300	394	47,744	2023/ 8 /15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	600	870	105,314	2030/ 5 /15
		6.5 T-BOND 261115	6.5	400	566	68,455	2026/11/15
		7.25 T-BOND 160515	7.25	700	747	90,461	2016/ 5 /15
		7.5 T-BOND 161115	7.5	1,500	1,656	200,337	2016/11/15
		8 T-BOND 211115	8.0	500	686	83,023	2021/11/15
		8.125 T-BOND 190815	8.125	500	638	77,250	2019/ 8 /15
		8.75 T-BOND 170515	8.75	900	1,044	126,261	2017/ 5 /15
		8.75 T-BOND 200815	8.75	700	950	114,995	2020/ 8 /15
		8.875 T-BOND 190215	8.875	600	768	92,983	2019/ 2 /15
		小 計					53,057,673
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	200	195	19,301	2020/ 9 / 1
		1 CAN GOVT 160801	1.0	1,100	1,104	109,107	2016/ 8 / 1
		1.25 CAN GOVT 170801	1.25	200	202	19,996	2017/ 8 / 1
		1.25 CAN GOVT 180201	1.25	400	405	40,086	2018/ 2 / 1
		1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	812	80,266	2018/ 3 / 1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	600	610	60,290	2018/ 9 / 1
		1.5 CAN GOVT 170201	1.5	800	810	80,132	2017/ 2 / 1
		1.5 CAN GOVT 170301	1.5	1,400	1,420	140,369	2017/ 3 / 1
		1.5 CAN GOVT 170901	1.5	900	916	90,561	2017/ 9 / 1
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	700	713	70,488	2020/ 3 / 1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	900	891	88,147	2023/ 6 / 1
		1.75 CAN GOVT 190301	1.75	600	619	61,265	2019/ 3 / 1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	700	722	71,431	2019/ 9 / 1
		2 CAN GOVT 160601	2.0	1,400	1,418	140,175	2016/ 6 / 1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	800	832	82,238	2025/ 6 / 1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,000	1,065	105,333	2024/ 6 / 1
		2.75 CAN GOVT 160901	2.75	1,700	1,744	172,393	2016/ 9 / 1

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	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	900	976	96,522	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	300	322	31,847	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	200	220	21,761	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	891	88,130	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	900	1,003	99,211	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,300	1,600	158,205	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,400	1,557	153,898	2019/6/1
		4 CAN GOVT 160601	4.0	700	723	71,507	2016/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	1,100	1,173	115,961	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,050	1,367	135,095	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	800	883	87,355	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	950	1,376	136,055	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	700	1,008	99,682	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	900	1,362	134,639	2033/6/1
8 CAN GOVT 270601	8.0	400	658	65,070	2027/6/1		
小 計						2,926,529	
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	14,800	19,188	152,550	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,500	6,266	49,814	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	15,500	15,538	123,528	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	6,200	6,316	50,212	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	5,000	4,947	39,329	2019/12/11
		6.25 MEXICAN BONO 160616	6.25	8,900	9,152	72,762	2016/6/16
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	8,800	9,220	73,299	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	7,700	8,043	63,943	2022/6/9
		7.25 MEXICAN BONO 161215	7.25	8,900	9,366	74,467	2016/12/15
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,900	6,548	52,061	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	10,400	11,253	89,463	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,800	11,093	88,189	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	3,500	3,965	31,528	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	8,400	9,545	75,888	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,600	7,378	58,660	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	6,300	7,185	57,122	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	10,000	11,189	88,955	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,800	8,192	65,129	2029/5/31
8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	7,100	8,654	68,800	2038/11/18		
小 計						1,375,710	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	800	797	107,338	2020/4/17
		0 SCHATS 160916	—	400	401	53,986	2016/9/16
		0 SCHATS 161216	—	100	100	13,504	2016/12/16
		0 SCHATS 170310	—	500	501	67,540	2017/3/10
		0.25 OBL 180413	0.25	1,100	1,113	149,781	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	800	808	108,813	2019/10/11
		0.25 SCHATS 160610	0.25	900	904	121,712	2016/6/10

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0.5 BUND 250215	0.5	1,100	1,090	146,680	2025/ 2 /15
		0.5 OBL 170407	0.5	1,600	1,621	218,186	2017/ 4 / 7
		0.5 OBL 171013	0.5	1,300	1,321	177,801	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,200	1,221	164,414	2018/ 2 /23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,100	1,123	151,187	2019/ 4 /12
		0.75 OBL 170224	0.75	1,200	1,220	164,220	2017/ 2 /24
		1 BUND 240815	1.0	1,300	1,352	181,955	2024/ 8 /15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,245	167,522	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,200	1,247	167,902	2019/ 2 /22
		1.25 OBL 161014	1.25	1,500	1,531	206,012	2016/10/14
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,410	189,730	2022/ 9 / 4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,300	1,411	189,887	2023/ 2 /15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,300	1,411	189,983	2023/ 5 /15
		1.5 BUND 240515	1.5	900	977	131,521	2024/ 5 /15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,100	1,212	163,145	2022/ 7 / 4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,500	1,662	223,753	2024/ 2 /15
		2 BUND 220104	2.0	1,400	1,562	210,183	2022/ 1 / 4
		2 BUND 230815	2.0	1,300	1,466	197,251	2023/ 8 /15
		2.25 BUND 200904	2.25	900	1,002	134,948	2020/ 9 / 4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,200	1,353	182,167	2021/ 9 / 4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,400	1,586	213,451	2021/ 1 / 4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,300	1,721	231,578	2044/ 7 / 4
		2.5 BUND 460815	2.5	650	867	116,677	2046/ 8 /15
		3 BUND 200704	3.0	1,600	1,839	247,496	2020/ 7 / 4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,700	1,953	262,896	2020/ 1 / 4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,300	1,543	207,632	2021/ 7 / 4
		3.25 BUND 420704	3.25	900	1,334	179,583	2042/ 7 / 4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,800	2,062	277,452	2019/ 7 / 4
		3.75 BUND 170104	3.75	1,500	1,597	214,883	2017/ 1 / 4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,700	1,936	260,529	2019/ 1 / 4
		4 BUND 160704	4.0	1,900	1,990	267,788	2016/ 7 / 4
		4 BUND 180104	4.0	1,400	1,553	209,053	2018/ 1 / 4
		4 BUND 370104	4.0	1,800	2,801	376,908	2037/ 1 / 4
		4.25 BUND 170704	4.25	1,700	1,860	250,373	2017/ 7 / 4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,400	1,591	214,186	2018/ 7 / 4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,000	1,653	222,485	2039/ 7 / 4
		4.75 BUND 280704	4.75	800	1,194	160,668	2028/ 7 / 4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,400	2,297	309,162	2034/ 7 / 4
		4.75 BUND 400704	4.75	900	1,603	215,785	2040/ 7 / 4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,200	1,995	268,443	2031/ 1 / 4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,000	1,584	213,154	2028/ 1 / 4
		6 BUND 160620	6.0	300	320	43,083	2016/ 6 /20
		6.25 BUND 240104	6.25	1,100	1,641	220,912	2024/ 1 / 4
		6.25 BUND 300104	6.25	600	1,045	140,659	2030/ 1 / 4
		6.5 BUND 270704	6.5	800	1,335	179,731	2027/ 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	
イタリア	国債証券	0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	912	122,723	2018/ 1 /15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	400	406	54,737	2019/12/ 1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	700	702	94,491	2022/ 4 /15
		1.5 ITALY GOVT 161215	1.5	1,000	1,022	137,604	2016/12/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,300	1,349	181,596	2019/ 8 / 1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	900	951	128,064	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 160515	2.25	500	511	68,755	2016/ 5 /15
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,500	1,615	217,325	2019/ 5 / 1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,500	1,587	213,601	2024/12/ 1
		2.75 ITALY GOVT 161115	2.75	1,100	1,144	153,940	2016/11/15
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	600	640	86,138	2046/ 9 / 1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,400	1,512	203,533	2017/11/ 1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,100	1,205	162,154	2018/ 6 / 1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,400	1,551	208,798	2018/12/ 1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,100	1,258	169,369	2030/ 3 / 1
		3.75 ITALY GOVT 160801	3.75	2,500	2,611	351,427	2016/ 8 / 1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,700	1,961	263,925	2021/ 3 / 1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,000	1,153	155,230	2021/ 5 / 1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,500	2,889	388,731	2021/ 8 / 1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,400	1,631	219,469	2024/ 9 / 1
		4 ITALY GOVT 170201	4.0	1,700	1,812	243,934	2017/ 2 / 1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,500	1,742	234,460	2020/ 9 / 1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,900	2,279	306,658	2037/ 2 / 1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,800	2,050	275,830	2019/ 2 / 1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,100	2,424	326,181	2019/ 9 / 1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,600	1,865	251,048	2020/ 3 / 1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	1,800	2,004	269,727	2018/ 2 / 1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	1,800	2,036	274,074	2018/ 8 / 1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	1,900	2,186	294,234	2019/ 3 / 1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,881	253,147	2020/ 2 / 1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,300	1,586	213,483	2023/ 5 / 1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,600	1,960	263,847	2024/ 3 / 1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,600	1,988	267,603	2026/ 3 / 1
		4.75 ITALY GOVT 160915	4.75	1,200	1,274	171,502	2016/ 9 /15
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	900	981	131,993	2017/ 5 / 1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,400	1,530	205,935	2017/ 6 / 1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,200	2,675	359,992	2021/ 9 / 1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,800	2,232	300,436	2023/ 8 / 1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,500	1,924	258,880	2028/ 9 / 1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,050	1,432	192,766	2044/ 9 / 1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,300	1,614	217,279	2022/ 3 / 1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,500	1,921	258,487	2025/ 3 / 1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,200	2,984	401,626	2034/ 8 / 1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,300	1,789	240,831	2039/ 8 / 1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,400	1,930	259,752	2040/ 9 / 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	5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	2,100	2,334	314,074	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,100	2,845	382,833	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,300	1,667	224,310	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,200	1,539	207,145	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	900	1,313	176,726	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,000	2,955	397,649	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,800	2,647	356,237	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	700	1,069	143,966	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,100	1,735	233,551	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 200525	—	600	593	79,882	2020/5/25
		0.25 O.A.T 161125	0.25	700	704	94,778	2016/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	1,500	1,524	205,165	2019/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	600	578	77,872	2025/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	1,700	1,742	234,464	2017/7/25
		1 O.A.T 180525	1.0	1,700	1,753	235,985	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	1,600	1,656	222,825	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	1,700	1,763	237,221	2019/5/25
		1.75 BTAN 170225	1.75	1,800	1,860	250,376	2017/2/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	1,900	2,070	278,550	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,200	2,390	321,585	2024/11/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	1,700	1,915	257,669	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	2,000	2,263	304,513	2024/5/25
		2.5 BTAN 160725	2.5	2,500	2,578	346,987	2016/7/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	2,600	2,917	392,544	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	1,800	2,113	284,306	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	2,600	3,101	417,312	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	2,500	2,936	395,072	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	2,700	3,193	429,711	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,000	1,374	184,912	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,800	3,256	438,129	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,200	2,786	374,970	2026/4/25
		3.75 O.A.T 170425	3.75	2,700	2,903	390,731	2017/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	2,800	3,251	437,470	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	2,500	3,007	404,625	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	1,800	2,014	271,059	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,700	2,533	340,849	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,000	1,634	219,975	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	800	1,332	179,274	2060/4/25
		4.25 O.A.T 171025	4.25	2,600	2,877	387,104	2017/10/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	1,800	2,062	277,549	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	1,600	1,864	250,833	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	2,400	3,109	418,391	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	1,700	2,766	372,174	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	1,600	2,529	340,400	2035/4/25
		5 O.A.T 161025	5.0	2,400	2,577	346,832	2016/10/25

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	
ユーロ					%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	5.5 O.A.T 290425	5.5	2,000	3,116	419,257	2029/4/25		
		5.75 O.A.T 321025	5.75	1,700	2,880	387,625	2032/10/25		
		6 O.A.T 251025	6.0	1,600	2,421	325,858	2025/10/25		
		8.5 O.A.T 191025	8.5	700	959	129,137	2019/10/25		
		8.5 O.A.T 230425	8.5	800	1,293	174,070	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	200	200	26,974	2018/4/15		
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	400	402	54,153	2020/1/15		
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	500	474	63,907	2025/7/15		
		0.5 NETH GOVT 170415	0.5	500	506	68,129	2017/4/15		
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,200	1,243	167,272	2018/1/15		
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	700	731	98,456	2019/1/15		
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,094	147,318	2023/7/15		
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,000	1,119	150,662	2024/7/15		
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,300	1,466	197,347	2022/7/15		
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	1,400	1,462	196,752	2017/1/15		
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	700	857	115,400	2033/1/15		
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	500	684	92,123	2047/1/15		
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,200	1,416	190,595	2021/7/15		
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,100	1,287	173,291	2020/7/15		
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	900	1,121	150,890	2023/1/15		
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,050	1,658	223,161	2042/1/15		
		4 NETH GOVT 160715	4.0	900	943	126,968	2016/7/15		
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,200	1,353	182,046	2018/7/15		
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,400	1,628	219,177	2019/7/15		
		4 NETH GOVT 370115	4.0	950	1,468	197,594	2037/1/15		
		4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,400	1,540	207,282	2017/7/15		
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	900	1,393	187,449	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	600	604	81,383	2017/10/31		
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,500	1,551	208,707	2020/1/31		
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,100	1,084	145,984	2025/4/30		
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	500	474	63,840	2030/7/30		
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	1,500	1,559	209,797	2017/4/30		
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,100	1,198	161,207	2019/4/30		
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,500	1,631	219,504	2024/10/31		
		3.25 SPAIN GOVT 160430	3.25	1,200	1,236	166,416	2016/4/30		
		3.3 SPAIN GOVT 160730	3.3	1,300	1,351	181,797	2016/7/30		
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,400	1,562	210,258	2018/10/31		
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	1,600	1,702	229,068	2017/1/31		
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,600	1,879	252,846	2024/4/30		
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,500	1,737	233,773	2020/4/30		
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,400	1,568	211,078	2018/7/30		
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,150	1,427	192,115	2037/1/31		
		4.25 SPAIN GOVT 161031	4.25	1,700	1,804	242,790	2016/10/31		
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,700	1,976	265,927	2019/10/31		
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,500	1,832	246,620	2023/10/31		

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	4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,500	1,672	225,075	2018/ 1 /31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,500	1,753	235,933	2019/ 7 /30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,100	1,390	187,033	2025/ 7 /30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	850	1,143	153,841	2041/ 7 /30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,100	1,382	186,071	2024/ 1 /31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,300	1,575	211,918	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	900	1,239	166,772	2040/ 7 /30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,100	1,466	197,253	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	700	1,019	137,133	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,100	1,416	190,541	2023/ 1 /31
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	1,500	1,677	225,670	2017/ 7 /30
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,500	1,887	254,027	2021/ 4 /30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,200	1,753	235,909	2032/ 7 /30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,700	2,206	296,852	2022/ 1 /31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,000	1,394	187,643	2026/ 7 /30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,400	2,009	270,433	2029/ 1 /31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	500	496	66,746	2025/ 6 /22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	800	831	111,918	2018/ 6 /22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,000	1,128	151,792	2023/ 6 /22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,100	1,277	171,930	2024/ 6 /22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	800	900	121,197	2019/ 9 /28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	500	634	85,408	2034/ 6 /22
		3.25 BEL GOVT 160928	3.25	700	732	98,564	2016/ 9 /28
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	1,100	1,184	159,356	2017/ 6 /28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,300	1,546	208,017	2020/ 9 /28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	450	675	90,875	2045/ 6 /22
		4 BEL GOVT 170328	4.0	900	969	130,491	2017/ 3 /28
		4 BEL GOVT 180328	4.0	800	893	120,217	2018/ 3 /28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	900	1,037	139,531	2019/ 3 /28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,000	1,242	167,144	2022/ 3 /28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	600	843	113,546	2032/ 3 /28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,000	1,245	167,642	2021/ 9 /28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,000	1,271	171,026	2022/ 9 /28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,050	1,659	223,225	2041/ 3 /28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	600	821	110,515	2026/ 3 /28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,450	2,346	315,784	2035/ 3 /28
5.5 BEL GOVT 170928	5.5	500	566	76,225	2017/ 9 /28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,300	1,985	267,173	2028/ 3 /28		
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	100	100	13,543	2019/10/18
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	600	651	87,616	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	300	328	44,155	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	600	645	86,897	2019/ 6 /18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	300	361	48,627	2034/ 5 /23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	400	574	77,231	2044/ 6 /20
		3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	800	847	113,969	2017/ 2 /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	3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	1,000	1,214	163,451	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	900	1,079	145,198	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	700	855	115,061	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	300	535	71,986	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	900	1,071	144,151	2020/7/15
		4 AUSTRIA GOVT 160915	4.0	700	738	99,379	2016/9/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	850	1,324	178,144	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	600	661	89,012	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,400	1,630	219,413	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	900	1,013	136,352	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	500	708	95,325	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	500	806	108,511	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	300	302	40,764	2020/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	200	190	25,568	2031/4/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	400	415	55,897	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	200	214	28,897	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	400	433	58,305	2022/9/15
		1.875 FINNISH GOV 170415	1.875	400	415	55,940	2017/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	400	446	60,095	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	300	397	53,495	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	365	49,126	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	578	77,890	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	400	475	64,035	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	300	328	44,155	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	400	527	70,913	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	400	471	63,381	2019/7/4
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	200	27,012	2022/3/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	400	398	53,569	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	300	332	44,756	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	715	96,205	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	487	65,644	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	400	468	63,090	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	700	805	108,312	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	800	957	128,791	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	600	742	99,947	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	800	1,105	148,774	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	500	566	76,262	2017/10/18
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	500	622	83,743	2019/10/18
小 計						51,488,739	
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	2,100	2,115	396,580	2017/9/7
		1.25 GILT 180722	1.25	2,300	2,321	435,147	2018/7/22
		1.75 GILT 170122	1.75	1,400	1,428	267,825	2017/1/22
		1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,144	402,013	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	1,800	1,802	338,002	2022/9/7

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	2 GILT 200722	2.0	1,100	1,131	212,094	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	200	199	37,323	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	1,700	1,752	328,483	2023/9/7
		2.75 GILT 240907	2.75	1,700	1,814	340,131	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	1,900	2,143	401,821	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,000	1,181	221,448	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,050	1,340	251,241	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	1,300	1,438	269,702	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	1,600	1,792	336,006	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	1,600	1,811	339,620	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	1,100	1,409	264,184	2052/7/22
		4 GILT 160907	4.0	1,500	1,568	294,042	2016/9/7
		4 GILT 220307	4.0	900	1,038	194,706	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	900	1,251	234,600	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	800	982	184,215	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	1,100	1,382	259,256	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	1,400	1,792	335,985	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	800	1,043	195,688	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	1,100	1,443	270,680	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,150	1,563	293,030	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	1,000	1,387	260,049	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,050	1,508	282,755	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	900	1,014	190,201	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,700	2,226	417,320	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,300	1,792	336,126	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	1,300	1,508	282,704	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,500	1,973	369,925	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,300	1,809	339,306	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	1,100	1,228	230,303	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	1,200	1,525	285,951	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	900	1,303	244,412	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	1,000	1,374	257,743	2021/6/7
8.75 GILT 170825	8.75	500	593	111,197	2017/8/25		
小 計						10,711,831	
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	300	341	44,019	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	320	364	46,999	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	500	550	70,961	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	360	412	53,141	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	320	422	54,503	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	420	625	80,707	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	300	331	42,715	2017/6/5
小 計						393,049	
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	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	4,400	4,711	68,218	2023/11/13

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	
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	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,800	5,602	81,129	2025/5/12
		3 SWD GOVT 160712	3.0	3,500	3,636	52,656	2016/7/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	5,200	6,286	91,025	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,000	4,169	60,373	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	4,600	5,018	72,665	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	6,100	7,110	102,966	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	5,800	7,324	106,063	2020/12/1
小 計						635,098	
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	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,600	1,611	25,812	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	3,500	3,623	58,052	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,200	3,560	57,046	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,800	5,460	87,484	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	4,400	4,692	75,168	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	4,100	4,653	74,545	2019/5/22
小 計						378,110	
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	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	4,400	4,746	85,618	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	3,200	3,503	63,200	2025/11/15
		2.5 DMK GOVT 161115	2.5	3,400	3,542	63,902	2016/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	6,400	7,489	135,112	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	3,600	3,978	71,766	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	7,100	8,365	150,921	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	8,600	14,314	258,229	2039/11/15
		7 DMK GOVT 241110	7.0	1,900	3,022	54,533	2024/11/10
小 計						883,285	
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	800	767	25,494	2020/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	1,800	1,824	60,602	2018/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	1,600	1,663	55,229	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	1,500	1,557	51,712	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,400	1,471	48,862	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	1,900	2,085	69,263	2023/10/25
		4.75 POLAND 161025	4.75	2,100	2,188	72,680	2016/10/25
		4.75 POLAND 170425	4.75	1,100	1,161	38,574	2017/4/25
		5.25 POLAND 171025	5.25	1,900	2,052	68,153	2017/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,300	1,488	49,439	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,300	1,476	49,038	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,100	1,310	43,510	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,600	1,932	64,190	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	600	788	26,202	2029/4/25
		POLAND 160725	—	600	588	19,543	2016/7/25
小 計						742,499	
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	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	700	714	68,299	2019/10/21

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			
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	1,500	1,485	142,036	2024/ 4 /21		
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	178	17,051	2035/ 6 /21		
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	600	621	59,420	2018/10/21		
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,200	1,230	117,685	2025/ 4 /21		
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	700	701	67,070	2029/ 4 /21		
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	600	619	59,246	2037/ 4 /21		
		4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,400	1,465	140,107	2017/ 7 /21		
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,000	1,113	106,486	2026/ 4 /21		
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,400	1,540	147,318	2020/ 4 /15		
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	700	804	76,958	2033/ 4 /21		
		4.75 AUST GOVT 160615	4.75	1,300	1,337	127,945	2016/ 6 /15		
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,000	1,165	111,413	2027/ 4 /21		
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,800	2,000	191,351	2019/ 3 /15		
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,300	1,414	135,236	2018/ 1 /21		
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,500	1,791	171,317	2023/ 4 /21		
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,600	1,888	180,636	2021/ 5 /15		
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,200	1,440	137,732	2022/ 7 /15		
		6 AUST GOVT 170215	6.0	1,700	1,814	173,508	2017/ 2 /15		
小計						2,230,824			
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	200	195	17,744	2018/ 4 / 1		
		1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	150	150	13,609	2019/10/ 1		
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	300	305	27,681	2021/ 6 / 1		
		2.375 SINGAPORGOV 170401	2.375	300	307	27,852	2017/ 4 / 1		
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	400	416	37,705	2019/ 6 / 1		
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	200	208	18,906	2023/ 7 / 1		
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	360	348	31,587	2042/ 4 / 1		
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	102	9,310	2029/ 7 / 1		
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	240	244	22,134	2030/ 9 / 1		
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	450	477	43,253	2024/ 9 / 1		
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	400	429	38,845	2022/ 9 / 1		
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	300	322	29,161	2020/ 9 / 1		
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	200	215	19,540	2033/ 9 / 1		
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	410	451	40,838	2027/ 3 / 1		
		3.75 SINGAPORGOVT 160901	3.75	600	621	56,269	2016/ 9 / 1		
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	300	326	29,522	2018/ 9 / 1		
		小計						463,963	
		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	3.172 MALAYSIA 160715	3.172	800	800	26,803	2016/ 7 /15		
		3.26 MALAYSIAGOVT 180301	3.26	700	695	23,292	2018/ 3 / 1		
		3.314 MALAYSIA 171031	3.314	600	599	20,060	2017/10/31		
		3.394 MALAYSIAGOV 170315	3.394	600	600	20,097	2017/ 3 /15		
		3.418MALAYSIAGOVT 220815	3.418	400	388	12,992	2022/ 8 /15		
		3.48 MALAYSIAGOVT 230315	3.48	1,300	1,259	42,156	2023/ 3 /15		
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	800	792	26,549	2020/ 3 /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	
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	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	900	846	28,325	2027/5/31
3.58MALAYSIAGOV 180928		3.58	800	801	26,826	2018/9/28	
3.654MALAYSIAGOV 191031		3.654	500	500	16,745	2019/10/31	
3.733MALAYSIAGO 280615		3.733	100	95	3,197	2028/6/15	
3.814MALAYSIAGOV 170215		3.814	1,200	1,209	40,479	2017/2/15	
3.844MALAYSIAGOV 330415		3.844	200	190	6,367	2033/4/15	
3.889MALAYSIAGO 200731		3.889	800	807	27,030	2020/7/31	
3.892MALAYSIAGOV 270315		3.892	800	782	26,203	2027/3/15	
4.012MALAYSIAGOV 170915		4.012	1,200	1,216	40,715	2017/9/15	
4.048MALAYSIA 210930		4.048	800	808	27,075	2021/9/30	
4.127MALAYSIA 320415		4.127	700	686	22,990	2032/4/15	
4.16MALAYSIAGOV 210715		4.16	1,000	1,019	34,124	2021/7/15	
4.181MALAYSIAGOV 240715		4.181	600	608	20,380	2024/7/15	
4.24MALAYSIAGOV 180207		4.24	1,000	1,019	34,133	2018/2/7	
4.262MALAYSIAGOV 160915		4.262	700	709	23,753	2016/9/15	
4.378MALAYSIAGOV 191129		4.378	1,500	1,544	51,719	2019/11/29	
4.392MALAYSIAGOV 260415		4.392	600	616	20,650	2026/4/15	
4.498MALAYSIAGOV 300415		4.498	600	624	20,892	2030/4/15	
4.935MALAYSIAGOV 430930		4.935	400	416	13,951	2043/9/30	
5.734MALAYSIAGOV 190730		5.734	500	540	18,094	2019/7/30	
小 計						675,612	
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	10.5SOUTH AFRICA 261221	10.5	10,300	12,183	123,661	2026/12/21
6.25SOUTH AFRICA 360331		6.25	6,100	4,721	47,926	2036/3/31	
6.5SOUTH AFRICA 410228		6.5	5,900	4,604	46,737	2041/2/28	
6.75SOUTH AFRICA 210331		6.75	5,000	4,791	48,628	2021/3/31	
7SOUTH AFRICA 310228		7.0	6,100	5,310	53,898	2031/2/28	
7.25SOUTH AFRICA 200115		7.25	5,100	5,049	51,254	2020/1/15	
7.75SOUTH AFRICA 230228		7.75	3,900	3,877	39,358	2023/2/28	
8SOUTH AFRICA 181221		8.0	4,600	4,704	47,746	2018/12/21	
8SOUTH AFRICA 300131		8.0	4,200	4,041	41,018	2030/1/31	
8.25SOUTH AFRICA 170915		8.25	4,400	4,513	45,810	2017/9/15	
8.25SOUTH AFRICA 320331		8.25	3,000	2,919	29,635	2032/3/31	
8.5SOUTH AFRICA 370131		8.5	3,400	3,351	34,022	2037/1/31	
8.75SOUTH AFRICA 440131		8.75	1,500	1,507	15,299	2044/1/31	
8.75SOUTH AFRICA 480228		8.75	6,100	6,133	62,255	2048/2/28	
小 計						687,254	
合 計						126,650,183	

(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

(2015年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 126,650,183	% 98.5
コール・ローン等、その他	1,919,335	1.5
投資信託財産総額	128,569,518	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（128,384,420千円）の投資信託財産総額（128,569,518千円）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=120.94円	1 カナダドル=98.82円	1 メキシコペソ=7.95円	1 ユーロ=134.55円
1 イギリスポンド=187.47円	1 スイスフラン=128.95円	1 スウェーデンクローネ=14.48円	1 ノルウェークローネ=16.02円
1 デンマーククローネ=18.04円	1 ポーランドズロチ=33.21円	1 オーストラリアドル=95.63円	1 シンガポールドル=90.55円
1 マレーシアリンギット=33.48円	1 南アフリカランド=10.15円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	129,225,326,156
コール・ローン等	474,298,821
公社債(評価額)	126,650,183,348
未収入金	1,005,406,163
未収利息	1,059,980,155
前払費用	35,457,669
(B) 負債	1,038,568,757
未払金	656,665,800
未払解約金	381,902,957
(C) 純資産総額(A－B)	128,186,757,399
元本	46,627,128,292
次期繰越損益金	81,559,629,107
(D) 受益権総口数	46,627,128,292口
1万口当たり基準価額(C／D)	27,492円

<注記事項>

①期首元本額	71,948,386,523円
期中追加設定元本額	3,044,240,090円
期中一部解約元本額	28,365,498,321円

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)

三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)	128,142,848円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	244,582,421円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	159,161,869円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	1,675,979,617円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	813,592,203円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	2,181,939,664円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	1,475,743,728円
三菱ＵＦＪ 財産分散ファンド(毎月決算型)	776,107,898円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	703,699,212円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	90,277,762円
F P バランスファンド(安定型)	76,380,395円
F P バランスファンド(安定成長型)	104,110,642円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	29,025,364円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,037,321,341円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	486,394,914円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,288,305,732円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドV A(適格機関投資家限定)	32,526,879,148円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型) V A(適格機関投資家限定)	158,545円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型) V A(適格機関投資家限定)	735,956円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドV A 2(適格機関投資家限定)	90,712,564円
MU AM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	1,737,876,469円
合計	46,627,128,292円

○損益の状況 (2014年5月21日～2015年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,331,274,475
受取利息	4,331,133,261
その他収益金	141,214
(B) 有価証券売買損益	16,167,820,885
売買益	19,440,181,430
売買損	△ 3,272,360,545
(C) 保管費用等	△ 42,600,138
(D) 当期損益金(A+B+C)	20,456,495,222
(E) 前期繰越損益金	102,919,406,211
(F) 追加信託差損益金	4,926,430,597
(G) 解約差損益金	△ 46,742,702,923
(H) 計(D+E+F+G)	81,559,629,107
次期繰越損益金(H)	81,559,629,107

- (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。

【お 知 ら せ】

- ①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月 1 日)
- ②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月 1 日)