

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（2006年5月15日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、日本を除く世界主要国の公社債へ投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざします。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	ベビーフンド	外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ DC海外債券インデックス ファンド

第10期（決算日：2016年5月12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 DC海外債券インデックスファンド」は、去る5月12日に第10期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱UFJ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 DC海外債券インデックスファンドのご報告

◇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	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	7
◇1万口当たりの費用明細	8
◇売買及び取引の状況	9
◇利害関係人との取引状況等	9
◇組入資産の明細	10
◇投資信託財産の構成	10
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	11
◇損益の状況	11
◇お知らせ	12

マザーファンドのご報告

◇外国債券インデックスマザーファンド	13
--------------------------	----

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、 円換算ベース)		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	中 率	期 騰 落	中 率			
	円		円	%		%	%	%	百万円
6期(2012年5月14日)	9,886		0	2.0	74,734.13	2.1	98.7	—	5,277
7期(2013年5月13日)	13,146		0	33.0	99,491.98	33.1	98.7	—	7,539
8期(2014年5月12日)	13,772		0	4.8	104,415.94	4.9	98.8	—	8,547
9期(2015年5月12日)	15,393		0	11.8	117,169.90	12.2	98.8	—	11,721
10期(2016年5月12日)	14,414		0	△ 6.4	109,931.94	△ 6.2	98.9	—	12,665

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	シ テ イ デ イ ン デ (除 く 日 本 、 円 換 算 ベ ー ス)	世 界 国 債 ス 騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
(期 首) 2015年 5 月12日	円 15,393	% —	117,169.90	% —	% 98.8	% —
5 月 末	15,765	2.4	119,576.28	2.1	97.3	—
6 月 末	15,523	0.8	117,821.48	0.6	98.7	—
7 月 末	15,734	2.2	119,513.99	2.0	98.8	—
8 月 末	15,486	0.6	117,759.56	0.5	98.1	—
9 月 末	15,443	0.3	117,295.48	0.1	98.8	—
10 月 末	15,452	0.4	117,390.65	0.2	98.7	—
11 月 末	15,438	0.3	117,622.76	0.4	98.9	—
12 月 末	15,221	△1.1	115,735.90	△1.2	98.5	—
2016年 1 月 末	15,452	0.4	117,720.03	0.5	97.9	—
2 月 末	14,660	△4.8	111,665.52	△4.7	98.9	—
3 月 末	14,920	△3.1	113,814.57	△2.9	101.9	—
4 月 末	14,436	△6.2	109,994.30	△6.1	98.9	—
(期 末) 2016年 5 月12日	14,414	△6.4	109,931.94	△6.2	98.9	—

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第10期：2015/5/13～2016/5/12)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ6.4%の下落となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－6.2%）を0.2%下回りました。

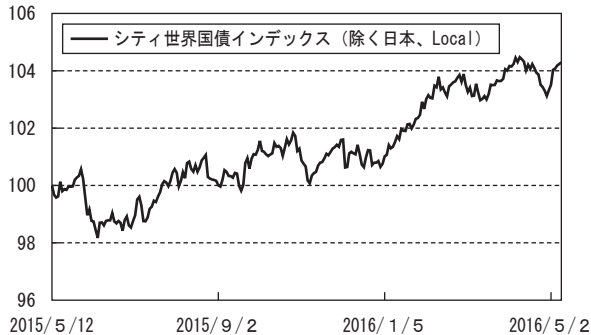


基準価額の主な変動要因

上昇要因	・世界的な景気減速懸念や原油をはじめとする商品市況の悪化によるインフレ期待の低下などを背景に、先進国の債券市況の指標であるシティ世界国債インデックス（除く日本、Local）が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	・世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルが対円で売られたことが基準価額の下落要因となりました。 ・ＥＣＢ（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られたことが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

(第10期：2015/5/13～2016/5/12)

債券市況の推移
(期首を100として指数化)

◎債券市況

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

為替市況の推移
(期首を100として指数化)

◎為替市況

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

当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド＞

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

＜外国債券インデックスマザーファンド＞

基準価額は期首に比べ6.1%の下落となりました。

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

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2015年5月12日）

最終利回り	1.3%
直接利回り	2.7%
デュレーション	6.6年

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
- ・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（2016年5月12日）

最終利回り	1.0%
直接利回り	2.4%
デュレーション	7.0年

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
- ・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 DC海外債券インデックスファンド＞
基準価額とベンチマークとの乖離は $\Delta 0.2\%$ 程度となりました。

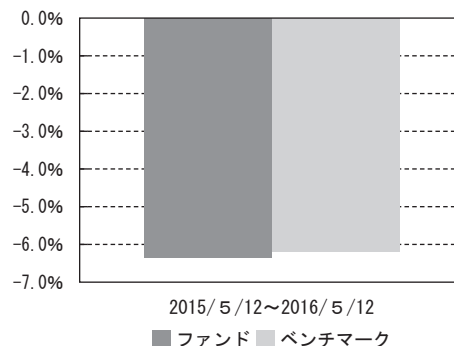
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク との乖離	$\Delta 0.2\%$ 程度	0.1% 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

(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。

◎マザーファンド保有以外の要因
ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.2\%$ 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 0.1% 程度でした。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



＜外国債券インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは 6.2% の下落となったため、乖離は 0.1% 程度となりました。

	ポートフォリオ要因	管理コスト等要因	評価時価差異に基づく要因	合 計
ベンチマークとの乖離	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	0.1% 程度	0.1% 程度

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

◎ポートフォリオ要因
ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.0\%$ 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 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10期
	2015年5月13日～2016年5月12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	6,296

(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 ＤＣ海外債券インデックスファンド＞

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

＜外国債券インデックスマザーファンド＞

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(15)	(0.097)	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)	(15)	(0.097)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(7)	(0.043)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0.016	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.015)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(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	38	0.254	
期中の平均基準価額は、15,294円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税を含む）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

(2015年5月13日～2016年5月12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
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	1,257,867	2,632,818	413,117	861,580

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

<三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド>

該当事項はございません。

<外国債券インデックスマザーファンド>

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

平均保有割合 8.2%

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

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 5,592,258	千口 6,437,009	千円 12,664,171

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 12,664,171	% 99.7
コール・ローン等、その他	40,273	0.3
投資信託財産総額	12,704,444	100.0

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（156,139,125千円）の投資信託財産総額（156,472,309千円）に対する比率は99.8%です。

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,704,444,561
コール・ローン等	32,136,937
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	12,664,171,518
未収入金	8,136,106
(B) 負債	39,232,244
未払解約金	24,018,482
未払信託報酬	15,213,664
未払利息	65
その他未払費用	33
(C) 純資産総額(A－B)	12,665,212,317
元本	8,786,790,149
次期繰越損益金	3,878,422,168
(D) 受益権総口数	8,786,790,149口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,414円

<注記事項>

- ①期首元本額 7,615,242,810円
期中追加設定元本額 2,413,342,599円
期中一部解約元本額 1,241,795,260円
また、1口当たり純資産額は、期末14,414円です。

②分配金の計算過程

項 目	2015年5月13日～ 2016年5月12日
費用控除後の配当等収益額	294,733,745円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	3,206,279,264円
分配準備積立金額	2,031,222,964円
当ファンドの分配対象収益額	5,532,235,973円
1万口当たり収益分配対象額	6,296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 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	10,413
受取利息	11,660
支払利息	△ 1,247
(B) 有価証券売買損益	△ 817,379,350
売買益	24,400,557
売買損	△ 841,779,907
(C) 信託報酬等	△ 30,209,081
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 847,578,018
(E) 前期繰越損益金	2,031,222,964
(F) 追加信託差損益金	2,694,777,222
(配当等相当額)	(3,199,872,540)
(売買損益相当額)	(△ 505,095,318)
(G) 計(D＋E＋F)	3,878,422,168
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	3,878,422,168
追加信託差損益金	2,694,777,222
(配当等相当額)	(3,206,279,264)
(売買損益相当額)	(△ 511,502,042)
分配準備積立金	2,325,956,709
繰越損益金	△1,142,311,763

- (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】

2015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)

外国債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

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

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

○最近5期の運用実績

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

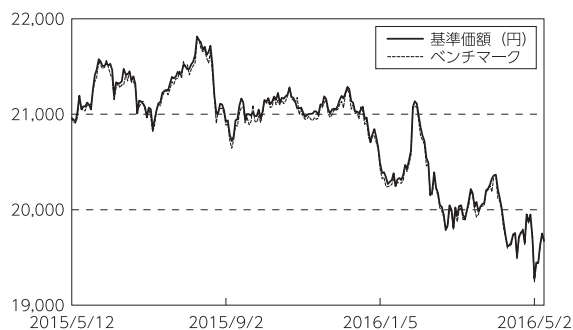
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは6.2%の下落となったため、カイ離は0.1%程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト等 要 因	評価時価差異に 基 づく 要 因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	△0.0%程度	△0.0%程度	0.1%程度	0.1%程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

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

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年 5 月13日～2016年 5 月12日)

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

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12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 250,628	千アメリカドル 207,257
	カナダ	国債証券	千カナダドル 14,520	千カナダドル 14,197
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 82,266	千メキシコペソ 53,859
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	32,612	30,597
	イタリア	国債証券	35,318	27,766
	フランス	国債証券	37,473	27,713
	オランダ	国債証券	8,541	8,739
	スペイン	国債証券	22,125	16,940
	ベルギー	国債証券	8,489	6,442
	オーストリア	国債証券	6,661	5,956
	フィンランド	国債証券	2,703	1,945
	アイルランド	国債証券	2,113	1,069
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 21,088	千イギリスポンド 17,009
	スイス	国債証券	千スイスフラン 488	千スイスフラン 412
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 17,764	千スウェーデンクローネ 13,804
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 9,603	千ノルウェークローネ 3,207
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 16,771	千デンマーククローネ 15,452
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 13,057	千ポーランドズロチ 8,331
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 12,624	千オーストラリアドル 7,616
シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 2,291	千シンガポールドル 2,103	
マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 7,692	千マレーシアリンギット 6,702	
南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 28,054	千南アフリカランド 13,988	

(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

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	34,058	1,659	4.9	27,994	1,524	5.4

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

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

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				
		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	0.5	2,800	2,795	302,985	2017/7/31
		0.625	3,800	3,801	411,982	2017/5/31
		0.625	2,100	2,100	227,639	2017/6/30
		0.625	3,500	3,500	379,295	2017/7/31
		0.625	6,400	6,398	693,378	2017/8/31
		0.625	5,400	5,397	584,900	2017/9/30
		0.625	2,800	2,797	303,151	2017/11/30
		0.625	2,400	2,395	259,580	2018/4/30
		0.75	2,700	2,704	293,079	2017/6/30
		0.75	5,500	5,505	596,663	2017/10/31
		0.75	3,100	3,101	336,156	2017/12/31
		0.75	2,000	2,001	216,900	2018/1/31
		0.75	4,000	4,002	433,767	2018/2/28
		0.75	2,900	2,901	314,481	2018/3/31
		0.75	1,800	1,800	195,165	2018/4/15
		0.75	3,000	2,992	324,309	2019/2/15
		0.875	3,800	3,812	413,141	2017/4/30
		0.875	2,800	2,809	304,419	2017/5/15
		0.875	2,700	2,708	293,501	2017/6/15
		0.875	1,800	1,805	195,660	2017/7/15
		0.875	1,600	1,604	173,913	2017/8/15
		0.875	1,800	1,805	195,637	2017/10/15
		0.875	2,300	2,306	249,961	2017/11/15
		0.875	2,100	2,105	228,190	2017/11/30
		0.875	1,400	1,403	152,138	2018/1/15
		0.875	2,300	2,306	249,981	2018/1/31
		0.875	400	401	43,474	2018/3/31
		0.875	2,200	2,205	239,000	2018/7/15
		0.875	3,600	3,606	390,878	2018/10/15
		0.875	2,800	2,800	303,518	2019/4/15
		0.875	900	899	97,456	2019/7/31
		1.0	3,600	3,616	391,945	2017/9/15
		1.0	3,600	3,617	391,975	2017/12/15
		1.0	2,200	2,210	239,559	2017/12/31
		1.0	1,600	1,608	174,265	2018/2/15
		1.0	2,100	2,111	228,777	2018/3/15
		1.0	2,200	2,211	239,652	2018/5/15
		1.0	2,700	2,714	294,153	2018/5/31
		1.0	3,000	3,015	326,773	2018/8/15
		1.0	2,600	2,613	283,225	2018/9/15
		1.0	1,500	1,506	163,221	2019/3/15
		1.0	2,000	2,007	217,527	2019/6/30
		1.0	1,000	1,002	108,628	2019/8/31
		1.0	1,800	1,803	195,492	2019/9/30
		1.0	1,800	1,801	195,233	2019/11/30
		1.125	2,200	2,217	240,304	2018/6/15

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘 柄			当 期 末				
			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	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	400	425	33,779	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	600	646	51,259	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	470	508	40,306	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	400	430	34,157	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	200	227	18,050	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	470	531	42,177	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	300	320	25,399	2018/9/1
小 計						539,944	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.26 MALAYSIAGOV 180301	3.26	900	903	24,360	2018/3/1
		3.314 MALAYSIA 171031	3.314	1,100	1,105	29,819	2017/10/31
		3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	879	23,730	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,173	31,654	2023/3/15
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	900	899	24,256	2020/3/31
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	800	750	20,252	2027/5/31
		3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	800	806	21,742	2018/9/28
		3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	700	705	19,027	2019/10/31
		3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	1,007	27,185	2020/10/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	600	572	15,435	2028/6/15
		3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	450	456	12,311	2019/3/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	900	898	24,244	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	200	200	5,400	2023/8/17
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	281	7,590	2033/4/15
		3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	700	710	19,154	2020/7/31
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	488	13,177	2027/3/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	1,150	1,154	31,131	2025/9/15
		4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,500	1,520	40,997	2017/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	915	24,688	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	700	682	18,399	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,200	1,228	33,138	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,400	1,423	38,381	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	300	301	8,128	2031/6/30
		4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,200	1,224	33,022	2018/2/7
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	350	347	9,376	2035/5/31
		4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,900	1,960	52,866	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,026	27,696	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,200	1,229	33,155	2030/4/15
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	600	619	16,699	2043/9/30	
	5.248 MALAYSIA 280915	5.248	200	219	5,909	2028/9/15	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	700	748	20,186	2019/7/30	
小 計						713,120	
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	15,000	16,338	117,800	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	7,350	5,129	36,980	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	7,200	4,977	35,889	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	5,700	5,267	37,981	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	8,000	6,367	45,912	2031/2/28

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

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

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

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

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

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

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

【お 知 ら せ】

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