

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（2001年12月18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	ベビード ファンド	外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザー ファンド	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビード ファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザー ファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

## 運用報告書（全体版）

# 三菱UFJ <DC> 外国債券インデックス ファンド

第16期（決算日：2017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>外国債券インデックスファンド」は、去る5月12日に第16期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

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

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客様専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

（9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額	
		税 分 配	込 金	期 騰 落	中 率	期 騰 落				中 率
	円		円		%		%		百万円	
12期(2013年5月13日)	15,891		0		32.4	99,491.98	33.1	98.7	—	3,585
13期(2014年5月12日)	16,574		0		4.3	104,415.94	4.9	98.8	—	3,777
14期(2015年5月12日)	18,439		0		11.3	117,169.90	12.2	98.8	—	4,258
15期(2016年5月12日)	17,188		0		△ 6.8	109,931.94	△ 6.2	98.9	—	3,980
16期(2017年5月12日)	17,258		0		0.4	111,054.04	1.0	98.7	—	3,985

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2016年5月12日	円	%		%	%	%
	17,188	—	109,931.94	—	98.9	—
5月末	17,363	1.0	111,018.88	1.0	98.8	—
6月末	16,395	△4.6	104,838.53	△4.6	98.9	—
7月末	16,653	△3.1	106,568.13	△3.1	98.7	—
8月末	16,520	△3.9	105,873.31	△3.7	98.2	—
9月末	16,202	△5.7	103,925.95	△5.5	99.0	—
10月末	16,219	△5.6	103,797.35	△5.6	98.8	—
11月末	16,864	△1.9	108,026.33	△1.7	98.6	—
12月末	17,381	1.1	111,331.80	1.3	98.5	—
2017年1月末	16,955	△1.4	108,860.69	△1.0	98.9	—
2月末	16,858	△1.9	108,568.93	△1.2	99.0	—
3月末	16,850	△2.0	108,641.98	△1.2	98.7	—
4月末	16,944	△1.4	109,024.53	△0.8	98.7	—
(期 末) 2017年5月12日						
	17,258	0.4	111,054.04	1.0	98.7	—

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

### 当期中の基準価額等の推移について

(第16期：2016/5/13～2017/5/12)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ0.4%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.0%)を0.6%下回りました。

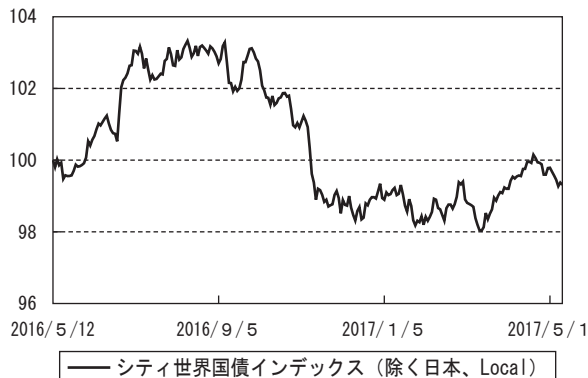


### 基準価額の主な変動要因

上昇要因	米連邦準備制度理事会 (FRB) の利上げに対する期待が高まったことなどを背景に、米ドルが対円で買われたことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	FRBの利上げに対する期待が高まったことなどを背景に、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) が下落したことや信託報酬等のコストなどが、基準価額の下落要因となりました。

## 投資環境について

(第16期：2016/5/13～2017/5/12)

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、2016年6月にかけて世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に上昇しましたが、その後、FRBの利上げに対する期待が高まったことなどから下落しました。

為替市況の推移  
(期首を100として指数化)

## ◎為替市況

- 円・米ドル相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルが対円で下落しましたが、その後、FRBの利上げに対する期待が高まったことなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で5.1%上昇しました。
- 円・ユーロ相場は、6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、ユーロが対円で下落しましたが、米国大統領選挙以降、大半の主要通貨に対して円安が進行し、ユーロは対円で上昇しました。期首との比較では、ユーロは対円でほぼ横ばいとなりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<三菱UFJ <DC>外国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1.1%の上昇となりました。

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

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2016年5月12日）

期末（2017年5月12日）

最終利回り	1.0%	➡	最終利回り	1.4%
直接利回り	2.4%		直接利回り	2.4%
デュレーション	7.0年		デュレーション	6.9年

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について

<三菱UFJ <DC>外国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 $\Delta 0.6\%$ 程度となりました。

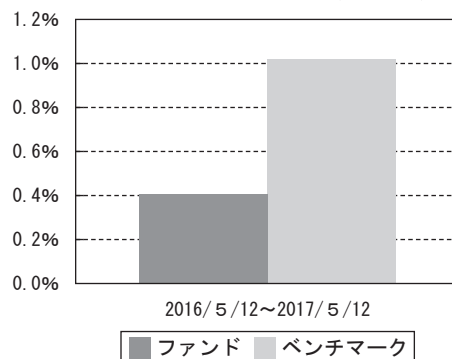
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク との乖離	$\Delta 0.7\%$ 程度	0.1%程度	$\Delta 0.6\%$ 程度

(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 $\Delta 0.7\%$ 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1.0%の上昇となったため、乖離は0.1%程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因  
ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。  
期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や  
年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因  
管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。  
カストディアン、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16期
	2016年5月13日～2017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	10,602

（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>外国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

(2016年5月13日～2017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 )	( 54 )	( 0. 323 )	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 )	( 54 )	( 0. 323 )	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 )	( 9 )	( 0. 054 )	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	3	0. 019	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	( 3 )	( 0. 015 )	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
( 監 査 費 用 )	( 1 )	( 0. 004 )	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
( そ の 他 )	( 0 )	( 0. 000 )	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	120	0. 719	
期中の平均基準価額は、16,767円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2016年5月13日～2017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
外国債券インデックスマザーファンド	千口 133, 410	千円 255, 662	千口 153, 577	千円 296, 003

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年5月13日～2017年5月12日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;三菱UFJ &lt;DC&gt;外国債券インデックスファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;外国債券インデックスマザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	B A	%	うち利害関係人 との取引状況D	D C	%
為替直物取引	百万円 20,196	百万円 11,410	56.5	百万円 45,263	百万円 15,571	34.4

平均保有割合 2.8%

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

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

## ○組入資産の明細

(2017年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	千口	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	2,023,133	2,023,133	2,002,966	3,984,701

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

(2017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	3,984,701	99.5
コール・ローン等、その他	21,214	0.5
投資信託財産総額	4,005,915	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(131,760,236千円)の投資信託財産総額(135,058,879千円)に対する比率は97.6%です。

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

1 アメリカドル=113.94円	1 カナダドル=83.13円	1 メキシコペソ=6.05円	1 ユーロ=123.80円
1 イギリスポンド=146.77円	1 スイスフラン=113.06円	1 スウェーデンクローネ=12.83円	1 ノルウェークローネ=13.25円
1 デンマーククローネ=16.64円	1 ポーランドズロチ=29.30円	1 オーストラリアドル=84.09円	1 シンガポールドル=80.91円
1 マレーシアリンギット=26.22円	1 南アフリカランド=8.52円		

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,005,915,792
コール・ローン等	16,939,631
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	3,984,701,161
未収入金	4,275,000
(B) 負債	20,647,996
未払解約金	6,907,035
未払信託報酬	13,665,309
未払利息	24
その他未払費用	75,628
(C) 純資産総額(A-B)	3,985,267,796
元本	2,309,225,873
次期繰越損益金	1,676,041,923
(D) 受益権総口数	2,309,225,873口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,258円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 2,316,144,444円  
 期中追加設定元本額 290,161,400円  
 期中一部解約元本額 297,079,971円  
 また、1口当たり純資産額は、期末17,258円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2016年5月13日～ 2017年5月12日
費用控除後の配当等収益額	65,801,197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	1,555,246,042円
分配準備積立金額	827,329,820円
当ファンドの分配対象収益額	2,448,377,059円
1万口当たり収益分配対象額	10,602円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

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

## 【お知らせ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2016年8月11日)

## ○損益の状況 (2016年5月13日～2017年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 4,603
受取利息	154
支払利息	△ 4,757
(B) 有価証券売買損益	55,559,570
売買益	66,964,996
売買損	△ 11,405,426
(C) 信託報酬等	△ 27,410,419
(D) 当期損益金(A+B+C)	28,144,548
(E) 前期繰越損益金	507,888,029
(F) 追加信託差損益金	1,140,009,346
(配当等相当額)	( 1,554,508,724)
(売買損益相当額)	(△ 414,499,378)
(G) 計(D+E+F)	1,676,041,923
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,676,041,923
追加信託差損益金	1,140,009,346
(配当等相当額)	( 1,555,246,042)
(売買損益相当額)	(△ 415,236,696)
分配準備積立金	893,131,017
繰越損益金	△ 357,098,440

- (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。

## 外国債券インデックスマザーファンド

### 《第16期》決算日2017年5月12日

[計算期間：2016年5月13日～2017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16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16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		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(除く日本、円換算ベース)	期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2017年5月12日)	19,894	1.1	111,054.04	1.0	98.8	—	132,430

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2016年 5月12日	円	%			%	%
	19,674	—	109,931.94	—	98.9	—
5 月 末	19,882	1.1	111,018.88	1.0	98.8	—
6 月 末	18,785	△4.5	104,838.53	△4.6	98.9	—
7 月 末	19,091	△3.0	106,568.13	△3.1	98.7	—
8 月 末	18,950	△3.7	105,873.31	△3.7	98.2	—
9 月 末	18,596	△5.5	103,925.95	△5.5	99.0	—
10 月 末	18,627	△5.3	103,797.35	△5.6	98.8	—
11 月 末	19,379	△1.5	108,026.33	△1.7	98.6	—
12 月 末	19,984	1.6	111,331.80	1.3	98.5	—
2017年 1 月 末	19,507	△0.8	108,860.69	△1.0	98.9	—
2 月 末	19,406	△1.4	108,568.93	△1.2	99.0	—
3 月 末	19,408	△1.4	108,641.98	△1.2	98.7	—
4 月 末	19,527	△0.7	109,024.53	△0.8	98.7	—
(期 末) 2017年 5月12日	19,894	1.1	111,054.04	1.0	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

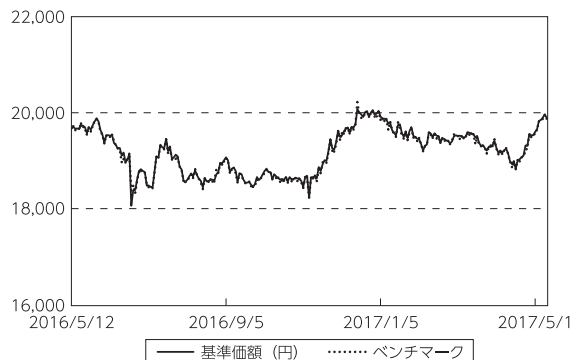
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.1%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(1.0%)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、2016年6月にかけて世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に上昇しましたが、その後、米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げに対する期待が高まったことなどから下落しました。

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルが対円で下落しましたが、その後、FRBの利上げに対する期待が高まったことなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で5.1%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、ユーロが対円で下落しましたが、米国大統領選挙以降、大半の主要通貨に対して円安が進行し、ユーロは対円で上昇しました。期首との比較では、ユーロは対円でほぼ横ばいとなりました。

●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1.0%の上昇となったため、乖離は0.1%程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

- 管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。
- ・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

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

◎今後の運用方針

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

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月13日～2017年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.015	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(3)	(0.015)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.015	
期中の平均基準価額は、19,261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

(2016年5月13日~2017年5月12日)

## 公社債

		買付額	売付額
外                       国	アメリカ	千アメリカドル 182,572	千アメリカドル 258,294
	カナダ	千カナダドル 10,399	千カナダドル 14,654
	メキシコ	千メキシコペソ 40,606	千メキシコペソ 72,264
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	千ユーロ 18,301	千ユーロ 34,456
	イタリア	千ユーロ 25,122	千ユーロ 43,336
	フランス	千ユーロ 25,800	千ユーロ 41,960
	オランダ	千ユーロ 5,317	千ユーロ 11,622
	スペイン	千ユーロ 14,486	千ユーロ 23,913
	ベルギー	千ユーロ 6,689	千ユーロ 12,048
	オーストリア	千ユーロ 3,505	千ユーロ 6,756
	フィンランド	千ユーロ 1,130	千ユーロ 2,243
	アイルランド	千ユーロ 1,306	千ユーロ 2,751
	イギリス	千イギリスポンド 13,951	千イギリスポンド 29,625
	スイス	千スイスフラン 202	千スイスフラン 1,787
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 8,075	千スウェーデンクローネ 19,532
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 6,067	千ノルウェークローネ 13,264
	デンマーク	千デンマーククローネ 10,184	千デンマーククローネ 24,457
	ポーランド	千ポーランドズロチ 9,452	千ポーランドズロチ 12,363
	オーストラリア	千オーストラリアドル 10,256	千オーストラリアドル 11,229
	シンガポール	千シンガポールドル 1,430	千シンガポールドル 1,981
	マレーシア	千マレーシアリンギット 4,440	千マレーシアリンギット 9,861
	南アフリカ	千南アフリカランド 16,098	千南アフリカランド 26,504

(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

(2016年5月13日～2017年5月12日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 20,196	百万円 11,410	% 56.5	百万円 45,263	百万円 15,571	% 34.4

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

(2017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 504,950	千アメリカドル 509,877	千円 58,095,390	% 43.9	% —	% 18.1	% 18.1	% 7.7
カナダ	千カナダドル 30,120	千カナダドル 32,879	2,733,243	2.1	—	0.9	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 190,200	千メキシコペソ 194,958	1,179,500	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	64,070	75,084	9,295,499	7.0	—	4.1	2.0	1.0
イタリア	89,500	100,673	12,463,436	9.4	—	5.4	2.8	1.2
フランス	88,660	103,434	12,805,157	9.7	—	6.0	2.9	0.8
オランダ	19,450	23,235	2,876,580	2.2	—	1.4	0.5	0.2
スペイン	50,850	58,897	7,291,500	5.5	—	3.3	1.5	0.7
ベルギー	21,700	26,317	3,258,154	2.5	—	1.8	0.5	0.2
オーストリア	13,300	15,758	1,950,868	1.5	—	0.9	0.4	0.1
フィンランド	5,850	6,491	803,591	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	7,550	8,584	1,062,742	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 52,055	千イギリスポンド 65,437	9,604,323	7.3	—	5.3	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン 1,760	千スイスフラン 2,118	239,568	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 40,100	千スウェーデンクローネ 45,885	588,717	0.4	—	0.3	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 26,250	千ノルウェークローネ 27,950	370,348	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 47,725	794,151	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 28,550	千ポーランドズロチ 28,991	849,437	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 30,650	千オーストラリアドル 32,814	2,759,409	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 5,910	千シンガポールドル 6,181	500,124	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 20,850	千マレーシアリンギット 20,831	546,198	0.4	—	0.2	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 92,450	千南アフリカランド 84,704	721,683	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	130,789,630	98.8	—	51.9	33.5	13.4

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ						
国債証券	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,386	271,960	2018/4/30
	0.625 T-NOTE 180630	0.625	4,000	3,973	452,786	2018/6/30
	0.75 T-NOTE 180430	0.75	200	199	22,690	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180831	0.75	3,900	3,874	441,501	2018/8/31
	0.75 T-NOTE 180930	0.75	2,600	2,581	294,103	2018/9/30
	0.75 T-NOTE 181031	0.75	300	297	33,921	2018/10/31
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	700	693	78,963	2019/2/15
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	3,000	2,958	337,133	2019/7/15
	0.75 T-NOTE 190815	0.75	2,300	2,267	258,305	2019/8/15
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	1,400	1,395	158,973	2018/5/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	2,200	2,191	249,679	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,500	2,485	283,236	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190415	0.875	2,000	1,982	225,894	2019/4/15
	0.875 T-NOTE 190515	0.875	2,000	1,981	225,752	2019/5/15
	0.875 T-NOTE 190615	0.875	1,800	1,781	203,001	2019/6/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	900	889	101,396	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	3,400	3,357	382,598	2019/9/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	1,700	1,696	193,296	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	2,600	2,594	295,595	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	2,700	2,692	306,736	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	2,600	2,590	295,190	2018/9/15
	1 T-NOTE 181130	1.0	500	497	56,705	2018/11/30
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,400	1,391	158,550	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	1,100	1,091	124,359	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	600	594	67,720	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,782	203,049	2019/9/30
	1 T-NOTE 191015	1.0	1,700	1,682	191,723	2019/10/15
	1 T-NOTE 191115	1.0	2,500	2,472	281,723	2019/11/15
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,800	1,779	202,808	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,197	250,432	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	1,800	1,794	204,491	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190131	1.125	1,700	1,694	193,085	2019/1/31
	1.125 T-NOTE 190228	1.125	1,600	1,594	181,684	2019/2/28
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,294	147,450	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,600	1,586	180,708	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200331	1.125	1,300	1,285	146,472	2020/3/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	4,000	3,952	450,383	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	2,400	2,344	267,153	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,000	1,944	221,595	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,200	2,136	243,461	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,700	2,619	298,504	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	2,700	2,616	298,072	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	2,100	2,098	239,124	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	1,600	1,599	182,197	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,498	284,638	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	2,000	1,998	227,728	2018/12/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,850	1,847	210,517	2019/1/31
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	600	598	68,243	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	1,400	1,393	158,799	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	2,400	2,385	271,768	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,350	1,340	152,743	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,700	1,666	189,929	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	2,000	1,946	221,791	2021/10/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,800	1,708	194,677	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,800	1,803	205,460	2018/6/30
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,300	2,303	262,491	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	2,800	2,804	319,505	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,000	1,001	114,069	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,500	1,501	171,090	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,200	1,201	136,856	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 191215	1.375	3,400	3,392	386,593	2019/12/15
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,750	1,745	198,857	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200215	1.375	1,700	1,694	193,054	2020/2/15
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,500	2,491	283,848	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,100	2,091	238,283	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	2,000	1,990	226,758	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,700	1,690	192,593	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,650	2,628	299,464	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	2,600	2,576	293,536	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,650	2,623	298,874	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	2,300	2,269	258,642	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,400	2,362	269,161	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,700	2,655	302,518	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,200	2,106	239,995	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,700	2,579	293,890	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,300	2,194	250,084	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	3,400	3,410	388,636	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,800	2,808	320,004	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,600	2,607	297,123	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,400	2,407	274,289	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,003	114,300	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,800	2,808	319,991	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	1,600	1,602	182,617	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,903	330,839	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200415	1.5	2,100	2,097	239,040	2020/4/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	2,000	1,995	227,399	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,300	2,257	257,209	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	1,900	1,840	209,754	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,800	1,741	198,442	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,500	5,093	580,355	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	2,700	2,714	309,320	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,100	1,106	126,029	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,700	1,708	194,711	2019/6/30

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,200	1,206	137,433	2019/7/31
		1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,100	3,115	355,007	2019/8/31
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,200	1,205	137,304	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 200315	1.625	3,000	3,009	342,848	2020/3/15
		1.625 T-NOTE 200630	1.625	2,700	2,702	307,950	2020/6/30
		1.625 T-NOTE 200731	1.625	2,200	2,201	250,805	2020/7/31
		1.625 T-NOTE 201130	1.625	2,400	2,394	272,793	2020/11/30
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,500	1,473	167,852	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,400	2,350	267,794	2022/11/15
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	3,400	3,309	377,136	2023/4/30
		1.625 T-NOTE 230531	1.625	1,500	1,458	166,223	2023/5/31
		1.625 T-NOTE 231031	1.625	800	774	88,289	2023/10/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,300	4,046	461,081	2026/2/15
		1.625 T-NOTE 260515	1.625	3,650	3,426	390,375	2026/5/15
		1.75 T-NOTE 181031	1.75	1,000	1,006	114,736	2018/10/31
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,300	2,318	264,170	2019/9/30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,700	1,704	194,227	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 201231	1.75	2,400	2,402	273,776	2020/12/31
		1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,300	1,292	147,288	2021/11/30
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,100	2,083	237,404	2022/2/28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,200	2,181	248,533	2022/3/31
		1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,000	1,981	225,814	2022/4/30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,400	1,387	158,095	2022/5/15
		1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,800	1,776	202,432	2022/9/30
		1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,000	1,966	224,087	2023/1/31
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,000	3,920	446,751	2023/5/15
		1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,000	1,008	114,963	2020/6/30
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,300	2,299	261,990	2021/11/30
		1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,550	2,545	290,070	2022/1/31
		1.875 T-NOTE 220228	1.875	2,600	2,595	295,757	2022/2/28
		1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,900	1,895	215,978	2022/3/31
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,000	1,993	227,185	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,690	192,593	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,000	1,984	226,099	2022/10/31
		2 T-NOTE 200731	2.0	1,400	1,416	161,447	2020/7/31
		2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,618	184,383	2020/9/30
		2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,313	149,695	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	1,700	1,716	195,559	2021/2/28
		2 T-NOTE 210531	2.0	2,000	2,016	229,731	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	2,300	2,314	263,699	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	2,400	2,412	274,887	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	3,400	3,419	389,575	2021/11/15
2 T-NOTE 211231	2.0	3,000	3,013	343,342	2021/12/31		
2 T-NOTE 220215	2.0	2,200	2,211	251,931	2022/2/15		
2 T-NOTE 220731	2.0	2,000	2,002	228,129	2022/7/31		
2 T-NOTE 221130	2.0	1,900	1,896	216,080	2022/11/30		
2 T-NOTE 230215	2.0	3,550	3,536	403,001	2023/2/15		

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250215	2.0	4,200	4,113	468,677	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	4,500	4,386	499,831	2025/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	4,150	4,009	456,818	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,200	2,234	254,604	2020/8/31
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	2,200	2,230	254,153	2021/1/31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,350	2,379	271,126	2021/6/30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,700	3,744	426,650	2021/8/15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,527	288,010	2021/9/30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,300	2,323	264,764	2021/12/31
		2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,800	1,814	206,726	2022/6/30
		2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,650	1,656	188,779	2022/12/31
		2.125 T-NOTE 231130	2.125	1,700	1,697	193,365	2023/11/30
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	1,800	1,792	204,258	2024/2/29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	2,000	1,990	226,794	2024/3/31
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	7,950	7,841	893,438	2025/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	3,000	2,531	288,490	2046/8/15
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	300	303	34,599	2018/7/31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,900	1,934	220,409	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,200	2,239	255,191	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,100	2,135	243,293	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	1,700	1,708	194,621	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 240131	2.25	1,900	1,908	217,416	2024/1/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,500	4,495	512,169	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	4,800	4,762	542,596	2025/11/15
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,650	4,587	522,660	2027/2/15
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,315	149,921	2018/5/31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,012	115,417	2018/6/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	800	818	93,302	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,000	4,037	460,032	2024/8/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	2,900	2,600	296,247	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	2,550	2,280	259,789	2046/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	2,850	2,547	290,226	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,300	3,373	384,373	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,750	4,839	551,447	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,300	1,317	150,141	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,300	2,373	270,415	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	4,100	4,231	482,117	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	1,700	1,617	184,330	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	1,550	1,473	167,914	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,300	1,332	151,819	2019/2/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,900	5,078	578,675	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,500	3,625	413,059	2024/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	2,850	2,769	315,570	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	2,900	2,805	319,635	2045/8/15	
	2.875 T-BOND 461115	2.875	2,700	2,610	297,471	2046/11/15	
	3 T-BOND 420515	3.0	1,450	1,446	164,825	2042/5/15	
	3 T-BOND 441115	3.0	2,850	2,829	322,445	2044/11/15	

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	3 T-BOND 450515	3.0	2,950	2,926	333,392	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,700	3,667	417,889	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	4,200	4,168	474,958	2047/2/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,050	1,073	122,356	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,400	1,430	162,980	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,800	1,831	208,729	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,000	3,052	347,748	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,700	2,795	318,489	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,400	2,524	287,630	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,100	3,301	376,117	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,000	3,141	357,936	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,097	125,049	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,300	2,432	277,130	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	2,350	2,609	297,275	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	3,050	3,390	386,341	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	2,200	2,307	262,956	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	2,900	3,066	349,438	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,300	3,529	402,175	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,100	1,247	142,107	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	3,050	3,460	394,323	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,700	2,798	318,898	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,200	1,385	157,846	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	500	513	58,494	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	900	930	106,042	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	500	609	69,396	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,250	1,524	173,680	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	400	497	56,713	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	550	681	77,609	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,500	1,859	211,834	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,100	1,367	155,805	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,100	1,387	158,087	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	1,950	2,466	281,044	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	550	692	78,931	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,500	1,922	219,098	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,400	1,832	208,741	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	400	536	61,153	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	650	828	94,410	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	400	511	58,290	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	900	1,197	136,406	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	777	88,590	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	500	645	73,513	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	600	805	91,757	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	3,500	4,355	496,213	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	650	918	104,602	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	500	675	76,927	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	800	1,011	115,236	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	689	78,541	2019/8/15

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	857	97,753	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,132	129,077	2019/2/15
小 計					58,095,390	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 180501	0.25	900	896	74,540	2018/5/1
	0.5 CAN GOVT 180801	0.5	800	798	66,378	2018/8/1
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	1,200	1,197	99,511	2018/11/1
	0.5 CAN GOVT 190201	0.5	400	398	33,151	2019/2/1
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,200	1,170	97,272	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 190501	0.75	800	800	66,560	2019/5/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,600	1,594	132,557	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,300	1,291	107,378	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	1,000	990	82,333	2021/9/1
	1 CAN GOVT 220901	1.0	250	248	20,661	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	500	472	39,247	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	1,200	1,209	100,513	2018/9/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	1,000	1,019	84,778	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,000	1,017	84,614	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,000	1,000	83,170	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	917	76,243	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,500	1,534	127,575	2019/9/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,000	1,065	88,565	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,000	1,080	89,849	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	950	1,028	85,474	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	850	946	78,708	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	320	370	30,773	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	872	72,568	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	900	972	80,846	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,200	1,508	125,361	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,400	1,486	123,560	2019/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,100	1,455	121,034	2041/6/1
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,000	1,037	86,254	2018/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	950	1,384	115,110	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	950	1,355	112,683	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	900	1,357	112,856	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	250	398	33,105	2027/6/1
小 計					2,733,243	
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	19,400	22,577	136,596	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,700	5,888	35,623	2036/11/20
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,600	10,386	62,840	2018/6/14
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	20,900	19,911	120,462	2019/12/11
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	9,000	8,153	49,326	2026/3/5
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	25,400	24,833	150,241	2021/6/10
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	10,000	9,726	58,845	2022/6/9
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,500	7,628	46,149	2027/6/3
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,800	10,078	60,976	2031/5/29



銘柄		当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	7,150	7,334	44,374	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	14,400	14,701	88,945	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	11,700	11,990	72,544	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	7,650	7,982	48,294	2023/12/7	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	1,300	1,364	8,252	2047/11/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	17,300	17,700	107,089	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,600	7,218	43,672	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	6,800	7,481	45,264	2038/11/18	
小 計					1,179,500		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,900	1,839	227,785	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,250	1,272	157,554	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	1,700	1,731	214,389	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	1,000	1,017	125,991	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	500	507	62,823	2022/4/8
		0 SCHATS 180615	—	700	705	87,326	2018/6/15
		0 SCHATS 180914	—	1,200	1,211	149,958	2018/9/14
		0 SCHATS 181214	—	600	606	75,084	2018/12/14
		0.25 BUND 270215	0.25	500	491	60,878	2027/2/15
		0.25 OBL 191011	0.25	1,700	1,736	215,016	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,450	1,489	184,374	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	1,800	1,854	229,557	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,800	2,860	354,078	2026/2/15
		0.5 OBL 190412	0.5	1,400	1,431	177,269	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,150	1,230	152,331	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,900	2,028	251,111	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,229	152,161	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,442	178,565	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,421	176,006	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,200	1,316	162,984	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,300	1,429	176,910	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,050	1,160	143,668	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,700	1,878	232,509	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,150	1,289	159,634	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,400	1,555	192,577	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,800	2,038	252,336	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,000	1,093	135,418	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,228	152,065	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,600	1,777	220,023	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,550	2,018	249,920	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,500	1,970	243,949	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,400	1,559	193,018	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,300	1,435	177,727	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	2,350	2,714	336,015	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,100	1,610	199,430	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,800	1,962	242,899	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,900	2,039	252,541	2019/1/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4 BUND 370104	4.0	1,700	2,631	325,790	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,800	1,902	235,583	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,020	1,673	207,193	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	800	1,167	144,532	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,450	2,358	291,953	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,200	2,114	261,821	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,200	1,957	242,396	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,100	1,689	209,130	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	600	851	105,354	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	750	1,267	156,900	2030/1/4
6.5 BUND 270704	6.5	800	1,283	158,944	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 191015	0.05	1,300	1,295	160,396	2019/10/15
		0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	900	902	111,676	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	200	201	24,892	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	700	704	87,234	2018/10/15
		0.35 ITALY GOVT 200615	0.35	800	799	98,921	2020/6/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	393	48,680	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,100	1,094	135,467	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	900	907	112,401	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	500	476	58,966	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,000	1,011	125,243	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,300	1,279	158,396	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	900	919	113,804	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,203	148,963	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,150	1,171	144,978	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	900	917	113,532	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,050	1,082	133,987	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,350	1,310	162,281	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,400	1,344	166,451	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,900	1,686	208,816	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	150	151	18,774	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,298	160,811	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	700	742	91,911	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	900	893	110,621	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	900	812	100,610	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	400	382	47,376	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,300	1,362	168,713	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,400	1,467	181,647	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,100	967	119,807	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	400	330	40,950	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,000	987	122,311	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,300	1,351	167,350	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,400	1,477	182,930	2018/12/1
3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,300	1,430	177,084	2030/3/1		
3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,000	2,245	277,948	2021/3/1		
3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,900	2,136	264,493	2021/5/1		
3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,600	2,933	363,151	2021/8/1		

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	3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,700	1,930	238,999	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,400	1,565	193,758	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,000	2,296	284,356	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,468	305,566	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,100	2,298	284,555	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,650	1,833	227,025	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,100	2,220	274,877	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,000	2,161	267,624	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,700	1,894	234,590	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,600	1,891	234,118	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,550	1,836	227,379	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,500	1,793	221,980	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	3,000	3,511	434,762	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,600	3,127	387,124	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,400	1,714	212,289	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,100	1,367	169,304	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,500	1,784	220,881	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,750	2,148	265,964	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,000	2,566	317,726	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,700	2,189	271,025	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,600	2,042	252,806	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,900	2,449	303,203	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,400	1,718	212,708	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,300	1,598	197,899	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,150	1,582	195,943	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,250	3,127	387,197	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,200	3,053	378,016	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	950	1,366	169,138	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,000	1,462	181,023	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 190225	—	700	706	87,491	2019/2/25
		0 O. A. T 200225	—	1,700	1,721	213,153	2020/2/25
		0 O. A. T 200525	—	2,250	2,279	282,158	2020/5/25
		0 O. A. T 210525	—	1,600	1,615	199,994	2021/5/25
		0 O. A. T 220525	—	1,500	1,502	186,001	2022/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	1,400	1,429	176,985	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	1,450	1,375	170,251	2026/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	2,100	2,152	266,532	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	2,800	2,792	345,706	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	2,100	2,059	254,905	2026/5/25
		1 O. A. T 180525	1.0	1,700	1,727	213,871	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	1,700	1,740	215,421	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	1,700	1,752	216,998	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	1,900	1,959	242,584	2025/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	1,350	1,278	158,335	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	2,050	2,115	261,946	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	2,600	2,852	353,178	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	2,650	2,912	360,550	2024/11/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 390625	1.75	900	911	112,861	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	550	490	60,717	2066/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	2,050	2,299	284,623	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	1,800	2,042	252,916	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	2,500	2,749	340,331	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	3,000	3,487	431,711	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	2,400	2,839	351,515	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,100	3,574	442,522	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	2,800	3,229	399,800	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,650	2,143	265,363	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,700	3,015	373,365	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,850	3,552	439,856	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	2,600	2,873	355,730	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,100	3,596	445,246	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,950	2,797	346,362	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,040	1,585	196,309	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	920	1,426	176,634	2060/4/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	1,900	2,032	251,657	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	2,250	2,461	304,716	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,250	4,098	507,362	2023/10/25
4.5 O.A.T 410425	4.5	2,150	3,327	411,882	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	2,050	3,125	386,953	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	2,250	3,390	419,693	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	2,150	3,498	433,133	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	1,900	2,759	341,656	2025/10/25		
8.5 O.A.T 191025	8.5	900	1,099	136,168	2019/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	700	1,050	129,998	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	300	303	37,567	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	900	919	113,865	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	900	894	110,760	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,300	1,302	161,298	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	250	252	31,290	2027/7/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,200	1,238	153,297	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,100	1,220	151,074	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,100	1,245	154,178	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,000	1,127	139,585	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,000	1,236	153,034	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	850	1,159	143,506	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,300	2,650	328,116	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	700	789	97,749	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	488	60,440	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,150	1,789	221,581	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,000	1,054	130,579	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,100	1,210	149,853	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,100	1,689	209,171	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,100	1,658	205,333	2028/1/15
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	700	1,004	124,296	2023/1/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,000	1,005	124,498	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	500	504	62,440	2019/1/31
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	150	149	18,554	2022/4/30
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,900	1,946	241,027	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,000	1,040	128,758	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,300	1,274	157,813	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,600	1,669	206,641	2020/1/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,050	1,036	128,320	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,600	1,641	203,264	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,450	1,509	186,828	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,500	1,477	182,888	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,600	1,696	210,064	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	100	99	12,337	2033/7/30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,600	1,695	209,872	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,250	2,507	310,416	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	800	787	97,512	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	300	308	38,137	2066/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	2,200	2,333	288,899	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,200	1,427	176,682	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,600	1,794	222,197	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,600	1,685	208,635	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,550	1,934	239,520	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,700	1,887	233,728	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,500	1,839	227,740	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,500	1,660	205,543	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,650	2,075	256,941	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,100	1,471	182,117	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,200	1,505	186,340	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,550	1,812	224,354	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,150	1,568	194,233	2040/7/30
5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	950	1,275	157,877	2028/10/31		
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	850	1,202	148,929	2044/10/31		
5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	2,200	2,793	345,808	2023/1/31		
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,700	2,065	255,761	2021/4/30		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,450	2,112	261,544	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,700	2,140	264,979	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,000	1,378	170,617	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,800	2,582	319,670	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	200	200	24,820	2023/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,900	1,944	240,725	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	600	597	73,950	2027/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	900	926	114,642	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	800	777	96,261	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	700	714	88,419	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	450	420	52,087	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	100	105	13,119	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	200	197	24,451	2066/6/22

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,150	1,304	161,494	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	200	207	25,655	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,100	1,278	158,291	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,000	1,084	134,246	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	450	564	69,858	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,450	1,654	204,886	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	700	1,002	124,052	2045/6/22
		4 BEL GOVT 190328	4.0	900	977	121,001	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,100	1,325	164,137	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	550	759	94,064	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,150	1,378	170,597	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,100	1,356	167,930	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,550	2,350	290,970	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	600	806	99,805	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,450	2,297	284,454	2035/3/28
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,400	2,085	258,227	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	100	99	12,329	2023/7/15
		0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	500	509	63,071	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	1,200	1,220	151,037	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	500	512	63,439	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,000	1,066	132,038	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	250	246	30,558	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	551	68,293	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	850	942	116,694	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	500	526	65,147	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	600	722	89,492	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	450	620	76,783	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	750	894	110,753	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,350	1,572	194,700	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	713	88,318	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	250	415	51,447	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,000	1,138	140,910	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	850	1,288	159,545	2037/3/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	800	872	108,002	2019/3/15
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	650	902	111,725	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	600	941	116,577	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	150	151	18,706	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	500	496	61,503	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	410	50,802	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	400	49,566	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	300	293	36,305	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	100	103	12,868	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	204	25,352	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	435	53,900	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	400	436	54,045	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	300	337	41,809	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	454	56,294	2042/7/4

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	
フィンランド	国債証券	2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	350	427	52,926	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	556	68,890	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	400	460	56,990	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	550	713	88,312	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	550	608	75,317	2019/7/4
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	400	416	51,544	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	650	656	81,233	2026/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	300	294	36,492	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	500	496	61,465	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	650	729	90,348	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	500	600	74,320	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	486	60,269	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	500	551	68,293	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	650	696	86,207	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,000	1,142	141,463	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	600	709	87,881	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	900	1,225	151,726	2025/3/13
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	500	577	71,496	2019/10/18
		小 計					
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	900	897	131,678	2022/7/22	
	1.25 GILT 180722	1.25	2,100	2,128	312,441	2018/7/22	
	1.25 GILT 270722	1.25	450	450	66,109	2027/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,850	1,931	283,504	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	1,700	1,758	258,154	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	400	372	54,702	2047/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,175	319,232	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,000	2,128	312,337	2022/9/7	
	1.75 GILT 370907	1.75	300	296	43,560	2037/9/7	
	1.75 GILT 570722	1.75	1,100	1,125	165,131	2057/7/22	
	2 GILT 200722	2.0	1,800	1,902	279,179	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	1,600	1,734	254,528	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,800	1,975	289,957	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	810	1,038	152,462	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	1,500	1,706	250,434	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	1,950	2,520	370,002	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,600	2,172	318,891	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	1,370	2,247	329,848	2068/7/22	
	3.75 GILT 190907	3.75	1,300	1,409	206,931	2019/9/7	
	3.75 GILT 200907	3.75	1,200	1,342	196,966	2020/9/7	
	3.75 GILT 210907	3.75	1,600	1,835	269,382	2021/9/7	
	3.75 GILT 520722	3.75	1,370	2,100	308,241	2052/7/22	
	4 GILT 220307	4.0	1,050	1,230	180,632	2022/3/7	
	4 GILT 600122	4.0	800	1,374	201,686	2060/1/22	
	4.25 GILT 271207	4.25	850	1,110	162,934	2027/12/7	
	4.25 GILT 320607	4.25	1,200	1,633	239,759	2032/6/7	
	4.25 GILT 360307	4.25	1,635	2,297	337,254	2036/3/7	

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	4.25 GILT 390907	4.25 1,120	1,620	237,805	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25 1,250	1,831	268,735	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25 1,250	1,942	285,045	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25 1,030	1,659	243,632	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25 1,250	2,158	316,752	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5 1,300	1,404	206,097	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5 1,500	2,138	313,833	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5 1,150	1,778	260,984	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75 1,200	1,355	199,017	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75 1,050	1,481	217,390	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75 1,220	1,868	274,304	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0 850	1,116	163,889	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0 750	1,135	166,687	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0 800	1,050	154,200	2021/6/7
小	計				9,604,323	
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	2.0 340	376	42,541	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25 310	339	38,385	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 190512	3.0 400	431	48,731	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0 280	352	39,904	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0 430	619	70,004	2028/4/8
小	計				239,568	
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 4,700	4,865	62,419	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5 6,600	7,146	91,685	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5 4,700	5,467	70,148	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5 6,850	8,077	103,628	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5 3,250	4,388	56,310	2039/3/30
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25 7,200	7,848	100,702	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0 6,800	8,092	103,822	2020/12/1
小	計				588,717	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5 2,600	2,592	34,349	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75 3,050	3,116	41,289	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75 1,550	1,565	20,748	2027/2/17
		2 NORWE GOVT 230524	2.0 4,200	4,385	58,101	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0 3,250	3,598	47,681	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75 5,900	6,550	86,791	2021/5/25
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5 5,700	6,142	81,386	2019/5/22
小	計				370,348	
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 3,200	3,239	53,901	2018/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5 1,550	1,520	25,308	2027/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5 3,600	3,927	65,359	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75 7,100	7,917	131,754	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0 6,800	7,788	129,607	2021/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0 6,950	7,716	128,409	2019/11/15



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		
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	千円	
国債証券	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,400	15,613	259,809	2039/11/15
小計					794,151	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	1,900	1,860	54,517	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	2,700	2,609	76,443	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	2,000	1,958	57,381	2021/4/25
	2.25 POLAND 220425	2.25	850	829	24,302	2022/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	1,600	1,617	47,386	2018/7/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	2,900	2,731	80,037	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	1,400	1,298	38,031	2027/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	2,000	2,052	60,147	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,900	1,912	56,035	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	2,250	2,384	69,870	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	1,300	1,422	41,678	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,300	1,404	41,157	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,300	1,467	43,007	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,650	1,885	55,258	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	600	741	21,718	2029/4/25
	POLAND 181025	—	2,000	1,948	57,096	2018/10/25
	POLAND 190425	—	900	865	25,367	2019/4/25
小計					849,437	
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	1,450	1,440	121,146	2020/11/21
	2 AUST GOVT 211221	2.0	1,050	1,046	87,963	2021/12/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	950	904	76,039	2028/5/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,800	1,842	154,949	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,950	1,991	167,447	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,450	1,454	122,295	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	900	896	75,391	2028/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	550	514	43,251	2035/6/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	600	533	44,858	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	900	920	77,403	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,100	2,209	185,807	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,450	1,512	127,216	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	300	292	24,619	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	700	746	62,738	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,300	2,602	218,815	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,000	2,151	180,892	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	800	944	79,464	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,000	2,364	198,813	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,700	1,809	152,131	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,750	2,062	173,461	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,150	2,459	206,830	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,800	2,115	177,870	2022/7/15
小計					2,759,409	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	1.25 SINGAPORGV 211001	1.25	200	197	15,971	2021/10/1

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
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	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	550	553	44,816	2019/10/1
	1.75 SINGAPORGOV 220401	1.75	50	50	4,061	2022/4/1
	2 SINGAPORGOV 200701	2.0	150	152	12,340	2020/7/1
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	100	100	8,103	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGOV 210601	2.25	600	614	49,711	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	300	306	24,807	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGOV 190601	2.5	500	512	41,481	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOV 230701	2.75	400	419	33,949	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOV 420401	2.75	340	354	28,706	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOV 460301	2.75	190	198	16,053	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	105	8,568	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOV 300901	2.875	300	317	25,685	2030/9/1
	3 SINGAPORGOV 240901	3.0	350	373	30,215	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOV 220901	3.125	350	374	30,266	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOV 200901	3.25	400	422	34,208	2020/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	230	258	20,944	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOV 270301	3.5	500	556	45,050	2027/3/1
	4 SINGAPORGOV 180901	4.0	300	311	25,180	2018/9/1
小計					500,124	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
国債証券	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	884	23,192	2022/8/15
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,179	30,913	2023/3/15
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	700	698	18,327	2020/3/31
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	281	7,369	2027/5/31
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	200	200	5,265	2018/9/28
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	1,100	1,104	28,964	2019/10/31
	3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	1,002	26,285	2020/10/15
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	600	569	14,939	2028/6/15
	3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	600	605	15,863	2019/3/15
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	900	900	23,612	2022/9/30
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	200	199	5,224	2023/8/17
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	600	562	14,754	2033/4/15
	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	700	706	18,517	2020/7/31
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	487	12,794	2027/3/15
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	500	497	13,047	2026/11/30
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	1,150	1,145	30,045	2025/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	913	23,951	2021/9/30
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	600	582	15,285	2032/4/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,050	1,070	28,067	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,000	1,014	26,587	2024/7/15
	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	800	785	20,587	2031/6/30
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	350	338	8,863	2035/5/31
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,750	1,787	46,874	2019/11/29
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,021	26,795	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	900	906	23,779	2030/4/15
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	500	497	13,049	2046/3/15
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	353	9,281	2043/9/30

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	
マレーシア		%	千マレーシアリングギット	千マレーシアリングギット	千円
国債証券	5.248 MALAYSIA 280915	5.248	200	217	5,707
	5.734MALAYSIAGOVT 190730	5.734	300	314	8,247
小 計					546,198
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド	
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	12,900	14,373	122,459
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	8,050	5,793	49,361
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	6,400	4,548	38,753
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,700	3,581	30,516
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	8,300	6,884	58,654
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	4,600	4,565	38,896
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,000	4,908	41,822
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	3,000	3,023	25,758
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	6,500	5,938	50,594
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,300	4,850	41,325
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	6,900	6,251	53,264
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,900	5,359	45,659
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	10,000	9,064	77,226
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	2,700	2,555	21,776
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	3,200	3,006	25,612
小 計					721,683
合 計					130,789,630

(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

(2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 130,789,630	% 96.8
コール・ローン等、その他	4,269,249	3.2
投資信託財産総額	135,058,879	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (131,760,236千円) の投資信託財産総額 (135,058,879千円) に対する比率は97.6%です。

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

1 アメリカドル=113.94円	1 カナダドル=83.13円	1 メキシコペソ=6.05円	1 ユーロ=123.80円
1 イギリスポンド=146.77円	1 スイスフラン=113.06円	1 スウェーデンクローネ=12.83円	1 ノルウェークローネ=13.25円
1 デンマーククローネ=16.64円	1 ポーランドズロチ=29.30円	1 オーストラリアドル=84.09円	1 シンガポールドル=80.91円
1 マレーシアリングギット=26.22円	1 南アフリカランド=8.52円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	135,979,672,180
コール・ローン等	1,288,484,942
公社債(評価額)	130,789,630,361
未収入金	2,785,838,363
未収利息	1,028,010,670
前払費用	87,707,844
(B) 負債	3,549,613,893
未払金	1,441,196,550
未払解約金	2,108,413,364
未払利息	3,979
(C) 純資産総額(A-B)	132,430,058,287
元本	66,568,708,547
次期繰越損益金	65,861,349,740
(D) 受益権総口数	66,568,708,547口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,894円

<注記事項>

- ①期首元本額 79,369,567,734円  
 期中追加設定元本額 13,460,264,160円  
 期中一部解約元本額 26,261,123,347円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9894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)	821,265,780円
eMAXIS 先進国債券インデックス	11,507,288,833円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,382,417,182円
eMAXIS バランス(波乗り型)	235,783,018円
コアバランス	1,384,859円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	340,241円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	201,099円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	470,926円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	72,793,229円
海外債券セレクション(ラップ向け)	3,753,251円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	22,528,484円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	7,007,945,425円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	41,113,041円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	18,601,350円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	14,975,628円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	21,995,342円
eMAXIS 最適化バランス(マイフoward)	6,029,049円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	1,099,638円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	1,302,553,961円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,286,110,907円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,107,382,988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)	19,104,565,071円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	7,767,247,723円
三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定)	2,012,259,532円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	462,962,970円

○損益の状況 (2016年5月13日~2017年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,481,304,903
受取利息	3,481,412,296
その他収益金	116,880
支払利息	△ 224,273
(B) 有価証券売買損益	△ 2,469,113,070
売買益	4,743,560,191
売買損	△ 7,212,673,261
(C) 保管費用等	△ 21,156,552
(D) 当期損益金(A+B+C)	991,035,281
(E) 前期繰越損益金	76,786,082,214
(F) 追加信託差損益金	12,413,548,035
(G) 解約差損益金	△24,329,315,790
(H) 計(D+E+F+G)	65,861,349,740
次期繰越損益金(H)	65,861,349,740

- (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 バランスファンドVA 45型 (適格機関投資家限定)	223,771,422円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	72,586,651円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,746,567,790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)	4,048,392円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	160,215,991円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	204,350,336円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	4,601,010円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	3,103,338円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	9,684,414円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	11,193,604円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	4,769,489円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	87,143,429円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	59,945,011円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	108,282,119円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	98,999,047円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	171,593,156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)	2,114,453,069円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	2,002,966,302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)	208,380,073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)	550,346,235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)	386,384,049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)	132,254,093円
合計	66,568,708,547円