


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（2009年10月28日設定）	
運用方針	外国債券インデックスマザーファンド受益証券を通じて、シティグループ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。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。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザー ファンド	シティグループ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。



eMAXIS 先進国債券インデックス



第4期（決算日：2013年1月28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「eMAXIS 先進国債券インデックス」は、去る1月28日に第4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
MUFG

東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

URL : <http://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト URL : <http://maxis.muam.jp/e/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

営業企画推進部

お客様専用フリーダイヤル

TEL. 0120-151034

(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客様の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

eMAXIS 先進国債券インデックスのご報告

◇設定以来の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	1
◇当期の運用経過	2
◇収益分配金	6
◇今後の運用方針	6
◇1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細	6
◇売買および取引の状況	6
◇主要な売買銘柄	7
◇利害関係人との取引状況等	7
◇組入資産の明細	7
◇投資信託財産の構成	20
◇資産、負債、元本および基準価額の状況	20
◇損益の状況	20
◇分配金のお知らせ	21
◇お知らせ	21

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	22
--------------------------	----

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。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			シティグループ 世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債券組 比率	債券 先比率	債券 先比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(除く日本、 円換算ベース)	期中 騰落率				
(設定日) 2009年10月28日	円 10,000	円 —	% —	81,026.26	% —	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2010年1月26日)	9,649	0	△ 3.5	77,997.01	△ 3.7	98.3	—	—	194
2期(2011年1月26日)	8,784	0	△ 9.0	71,443.40	△ 8.4	98.5	—	—	1,202
3期(2012年1月26日)	8,719	0	△ 0.7	70,966.73	△ 0.7	98.6	—	—	1,809
4期(2013年1月28日)	10,805	0	23.9	88,978.51	25.4	98.6	—	—	2,756

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) シティグループ世界国債インデックス(除く日本)とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し指数化した債券インデックスです。シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)とは、シティグループ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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		シティグループ 世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債券組入 比率	債券先物 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2012年1月26日	円 8,719	% —	70,966.73	% —	% 98.6	% —
1月末	8,654	△ 0.7	70,665.73	△ 0.4	98.5	—
2月末	9,293	6.6	75,886.43	6.9	98.6	—
3月末	9,376	7.5	76,501.98	7.8	98.7	—
4月末	9,265	6.3	75,963.13	7.0	98.5	—
5月末	8,824	1.2	72,421.74	2.1	98.2	—
6月末	8,872	1.8	72,683.09	2.4	98.6	—
7月末	8,826	1.2	72,360.01	2.0	98.6	—
8月末	8,976	2.9	73,670.33	3.8	98.9	—
9月末	9,037	3.6	74,066.36	4.4	98.7	—
10月末	9,284	6.5	76,328.87	7.6	98.5	—
11月末	9,663	10.8	79,446.53	11.9	98.6	—
12月末	10,301	18.1	84,675.03	19.3	98.5	—
(期末) 2013年1月28日	10,805	23.9	88,978.51	25.4	98.6	—

(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。

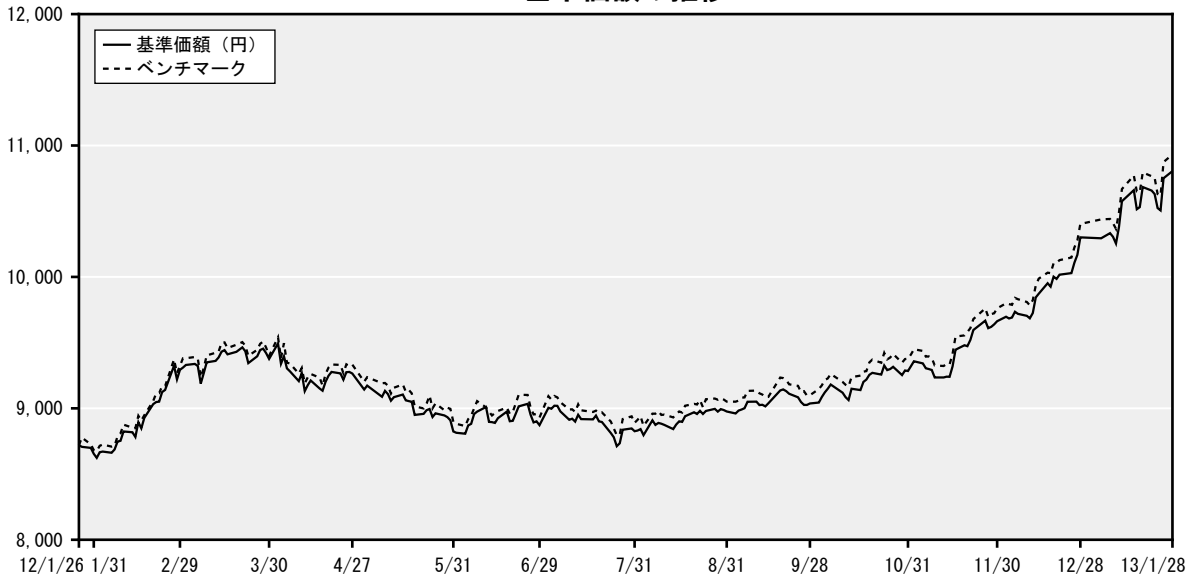
(注) 「債券先物比率」は買建比率—売建比率。

当期の運用経過

■ 基準価額の推移

基準価額は期首に比べ23.9%の上昇となりました。

基準価額の推移



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

■ 基準価額の変動要因

- ・当ファンドは、主として、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）に投資しており、これを通じて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。
- ・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。

■ ベンチマークとの比較

- ・基準価額とベンチマークとの乖離は△1.5%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	△0.8%程度	△0.7%程度	△1.5%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△0.8%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△0.7%程度でした。

なお、要因の詳細な説明については、実質的な運用を行っているマザーファンドの項で説明します。

マザーファンドの運用経過は、以下の通りです。

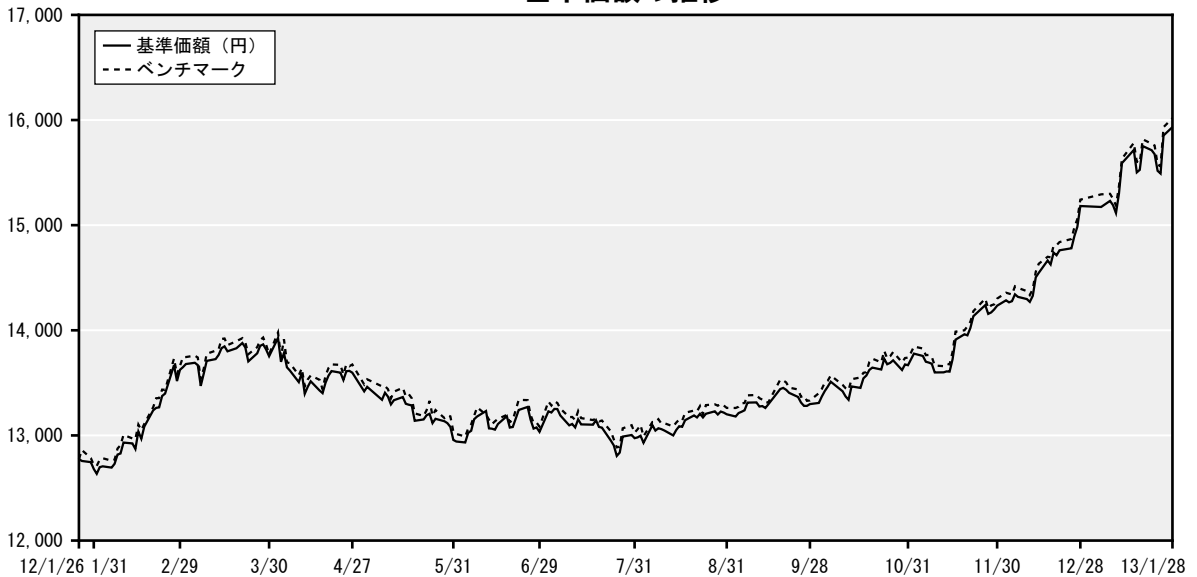
＜外国債券インデックスマザーファンド＞

(記載文章はベビーファンドの計算期間に基づいています。)

◆ 基準価額の推移

基準価額は期首に比べ24.7%の上昇となりました。

基準価額の推移



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

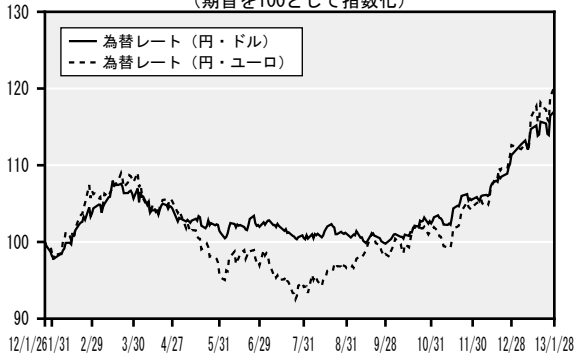
◆ 基準価額の変動要因

- ・当ファンドは、シティグループ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。
- ・ベンチマークであるシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）は期首と比べて25.4%の上昇となりました。基準価額はベンチマークにほぼ連動する形で推移しました。

債券市況の推移 (期首を100として指数化)



為替市況の推移 (期首を100として指数化)



◎債券市況

- ・前半は、世界経済の先行き不透明感が強まったことや、欧州の債務問題に対する懸念などを背景に、米国・ドイツなど主要国を中心に債券が買われ、金利は低下（債券価格は上昇）しました。その後、ECB（欧州中央銀行）による新たな国債買い入れプログラムの発表や、ECB総裁のユーロ圏支援に対する前向きな発言などを受けて、欧州債務問題の深刻化懸念が後退し、欧州周辺国の債券が買い戻されたことから金利は低下しました。

◎為替市況

- ・円・ドル相場は、米国景気の回復期待や、本邦衆院選で自民党が勝利したことなど、緩和的な金融政策への期待が高まったことなどを背景に、ドル買いが優勢となりました。期首との比較では、ドルは対円で17.0%の上昇となりました。
- ・円・ユーロ相場は、ECBの政策に対する期待から、欧州債務問題に対する深刻化懸念が後退したことや、日銀の追加金融緩和観測などを受けて、ユーロが買われました。期首との比較では、ユーロは対円で20.3%上昇しました。

◆ ベンチマークとの比較

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.7\%$ 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	0.1%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.7\%$ 程度	$\Delta 0.7\%$ 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。

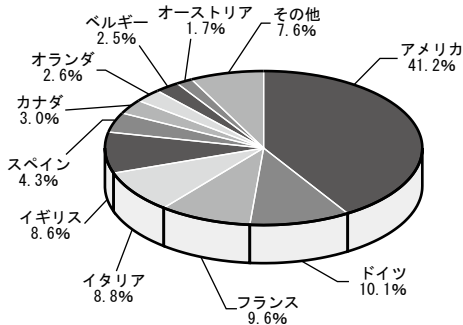
◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.1%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、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。

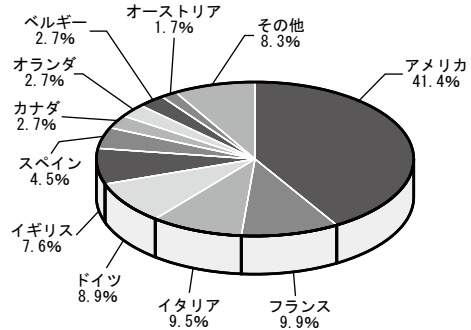
国別構成比

期首 (2012年 1月26日)



(注) 比率は現物債券評価額に対する割合です。

期末 (2013年 1月28日)



(注) 比率は現物債券評価額に対する割合です。

利回り・デュレーション (平均回収期間)

期首 (2012年 1月26日)

最終利回り	2.0%
直接利回り	3.2%
デュレーション	6.1年

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

期末 (2013年 1月28日)

最終利回り	1.6%
直接利回り	3.0%
デュレーション	6.0年

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

◎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△0.7%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。

収益分配金

<eMAXIS 先進国債券インデックス>

収益分配金につきましては、基準価額水準や市況動向等を勘案しましたが、見送りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益につきましては、信託財産中に留保し運用の基本方針に基づいて運用いたします。

なお、収益分配金の計算過程につきましては、損益の状況の<注記事項>をご参照ください。

今後の運用方針

<eMAXIS 先進国債券インデックス>

- ・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、当ファンドの運用方針を堅持します。
- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 銀 行)	58円 (26) (26) (6)
(b) 保 管 費 用 等	1
合 計	59

(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、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率

(b) 保管費用等は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 保管費用等は、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。

売買および取引の状況

(2012年1月27日～2013年1月28日)

設定、解約状況

	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 443,556	千円 602,616	千口 129,842	千円 180,060

主要な売買銘柄

(2012年1月27日～2013年1月28日)

外国債券インデックスマザーファンドにおける公社債の売買

買		付		売		付	
銘柄	金額	銘柄	金額	銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円		千円		千円
2 T-NOTE 220215(アメリカ)	804,482	4.5 GILT 130307(イギリス)	545,204	0.75 T-NOTE 171031(アメリカ)	575,822	1.375 T-NOTE 130215(アメリカ)	515,234
0.25 T-NOTE 140531(アメリカ)	555,025	1.375 T-NOTE 130115(アメリカ)	514,149	0.25 T-NOTE 140228(アメリカ)	492,651	1.375 T-NOTE 130315(アメリカ)	492,420
0.375 T-NOTE 150315(アメリカ)	479,566	0.375 T-NOTE 130731(アメリカ)	489,745	0.75 T-NOTE 220515(アメリカ)	475,350	0.25 T-NOTE 131130(アメリカ)	476,562
0.25 T-NOTE 140331(アメリカ)	457,731	4.25 T-NOTE 131115(アメリカ)	443,528	0.25 T-NOTE 151015(アメリカ)	441,789	0.25 T-NOTE 131031(アメリカ)	433,103
0.25 T-NOTE 151215(アメリカ)	435,703	3.375 T-NOTE 191115(アメリカ)	425,946	0.25 T-NOTE 140630(アメリカ)	432,572	1.75 T-NOTE 130415(アメリカ)	424,314

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) 外国の売買金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

利害関係人との取引状況等

(2012年1月27日～2013年1月28日)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

〈外国債券インデックスマザーファンド〉

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	%	うち利害関係人との取引状況 D	D/C	%
公社債	百万円 30,760	—	—	百万円 40,781	—	—
為替直物取引	14,923	30	0.2	29,716	11	0.0

平均保有割合 1.3%

※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ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

* 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

親投資信託残高

種類	期首(前期末)	当期		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 1,415,956	千口 1,729,671	千円 2,755,885	千円 2,755,885

(注) 外国債券インデックスマザーファンド全体の受益権口数は(期末: 110,512,512千口)です。

〈補足情報〉

下記は、外国債券インデックスマザーファンド全体の内容です。

■ 外国公社債

(A) 外国（外貨建）公社債の種類別開示

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 733,640	千アメリカドル 789,490	千円 71,867,299	% 40.8	% —	% 14.2	% 17.0	% 9.6	
カ ナ ダ	千カナダドル 46,000	千カナダドル 52,442	4,737,097	2.7	—	1.2	0.8	0.6	
メ キ シ コ	千メキシコペソ 201,400	千メキシコペソ 236,351	1,697,003	1.0	—	0.6	0.3	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ							
ド イ ツ	110,740	126,571	15,503,784	8.8	—	4.6	2.8	1.4	
イ タ リ ア	127,050	134,657	16,494,199	9.4	—	5.8	2.7	0.9	
フ ラ ン ス	124,600	140,998	17,270,926	9.8	—	5.6	2.9	1.3	
オ ラ ン ダ	34,200	38,590	4,726,921	2.7	—	1.5	0.8	0.5	
ス ペ イ ン	63,450	63,757	7,809,701	4.4	—	2.1	1.7	0.6	
ベルギー	33,200	38,307	4,692,224	2.7	—	1.6	0.8	0.2	
オーストリア	21,050	24,490	2,999,835	1.7	—	0.9	0.6	0.2	
フィンランド	8,000	8,859	1,085,194	0.6	—	0.3	0.2	0.1	
アイルランド	10,750	11,315	1,386,064	0.8	0.8	0.6	0.1	0.1	
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 78,935	千イギリスポンド 91,400	13,126,095	7.5	—	5.2	1.4	0.9	
ス イ ス	千スイスフラン 6,300	千スイスフラン 7,367	723,226	0.4	—	0.2	0.2	0.0	
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローネ 67,000	千スウェーデンクローネ 74,947	1,055,267	0.6	—	0.3	0.2	0.1	
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 24,900	千ノルウェークローネ 27,392	450,331	0.3	—	0.1	0.1	—	
デンマーク	千デンマーククローネ 69,800	千デンマーククローネ 85,005	1,395,798	0.8	—	0.5	0.2	0.1	
ポーランド	千ポーランドズロチ 41,600	千ポーランドズロチ 44,966	1,322,904	0.8	—	0.3	0.4	0.1	
オーストラリア	千オーストラリアドル 25,600	千オーストラリアドル 28,246	2,678,910	1.5	—	0.7	0.6	0.2	
シンガポール	千シンガポールドル 8,350	千シンガポールドル 9,187	677,181	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
マレーシア	千マレーシアリングギット 30,500	千マレーシアリングギット 31,534	939,728	0.5	—	0.2	0.2	0.1	
南アフリカ	千南アフリカランド 98,700	千南アフリカランド 104,758	1,063,299	0.6	—	0.4	0.1	0.0	
合 計	—	—	173,702,997	98.6	0.8	47.2	34.2	17.2	

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

(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国 (外貨建) 公社債の詳細開示 (個別銘柄別)

2013年1月28日現在

銘柄名	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	
0.125 T-NOTE 131231	0.125	3,500	3,498	318,492	2013/12/31
0.125 T-NOTE 140731	0.125	5,500	5,490	499,765	2014/7/31
0.25 T-NOTE 140131	0.25	5,000	5,003	455,452	2014/1/31
0.25 T-NOTE 140228	0.25	6,000	6,004	546,564	2014/2/28
0.25 T-NOTE 140331	0.25	5,800	5,803	528,283	2014/3/31
0.25 T-NOTE 140430	0.25	5,000	5,001	455,327	2014/4/30
0.25 T-NOTE 140531	0.25	7,000	7,001	637,384	2014/5/31
0.25 T-NOTE 140630	0.25	5,500	5,501	500,801	2014/6/30
0.25 T-NOTE 140831	0.25	4,000	4,000	364,120	2014/8/31
0.25 T-NOTE 140915	0.25	5,400	5,401	491,696	2014/9/15
0.25 T-NOTE 141215	0.25	5,000	4,998	454,972	2014/12/15
0.25 T-NOTE 150115	0.25	5,000	4,996	454,847	2015/1/15
0.25 T-NOTE 150215	0.25	5,000	4,995	454,705	2015/2/15
0.25 T-NOTE 150515	0.25	4,200	4,192	381,653	2015/5/15
0.25 T-NOTE 150715	0.25	5,300	5,286	481,271	2015/7/15
0.25 T-NOTE 150815	0.25	5,100	5,086	462,983	2015/8/15
0.25 T-NOTE 150915	0.25	4,800	4,784	435,510	2015/9/15
0.25 T-NOTE 151015	0.25	5,400	5,380	489,795	2015/10/15
0.25 T-NOTE 151215	0.25	4,800	4,778	435,015	2015/12/15
0.375 T-NOTE 141115	0.375	5,000	5,009	456,056	2014/11/15
0.375 T-NOTE 150315	0.375	6,000	6,008	546,990	2015/3/15
0.375 T-NOTE 150415	0.375	5,200	5,207	474,003	2015/4/15
0.375 T-NOTE 150615	0.375	4,200	4,203	382,684	2015/6/15
0.375 T-NOTE 151115	0.375	4,700	4,697	427,623	2015/11/15
0.5 T-NOTE 140815	0.5	4,300	4,316	392,958	2014/8/15
0.5 T-NOTE 141015	0.5	5,300	5,321	484,437	2014/10/15
0.5 T-NOTE 170731	0.5	5,500	5,438	495,052	2017/7/31
0.625 T-NOTE 140715	0.625	5,000	5,028	457,727	2014/7/15
0.625 T-NOTE 170531	0.625	5,300	5,280	480,649	2017/5/31
0.625 T-NOTE 170831	0.625	3,200	3,179	289,395	2017/8/31
0.75 T-NOTE 140615	0.75	4,900	4,935	449,252	2014/6/15
0.75 T-NOTE 171031	0.75	7,000	6,980	635,442	2017/10/31
0.75 T-NOTE 171231	0.75	2,800	2,787	253,729	2017/12/31
0.875 T-NOTE 161130	0.875	6,000	6,061	551,812	2016/11/30
0.875 T-NOTE 161231	0.875	4,000	4,038	367,647	2016/12/31
0.875 T-NOTE 170131	0.875	3,400	3,431	312,355	2017/1/31
0.875 T-NOTE 170228	0.875	4,300	4,337	394,808	2017/2/28
0.875 T-NOTE 170430	0.875	5,300	5,339	486,020	2017/4/30
1 T-NOTE 140115	1.0	3,500	3,527	321,143	2014/1/15
1 T-NOTE 140515	1.0	4,600	4,645	422,909	2014/5/15
1 T-NOTE 160831	1.0	4,500	4,572	416,211	2016/8/31
1 T-NOTE 160930	1.0	5,000	5,078	462,332	2016/9/30
1 T-NOTE 161031	1.0	5,200	5,280	480,641	2016/10/31
1 T-NOTE 170331	1.0	5,200	5,268	479,587	2017/3/31
1 T-NOTE 191130	1.0	2,500	2,447	222,765	2019/11/30
1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,593	145,056	2019/5/31
1.25 T-NOTE 140215	1.25	4,000	4,044	368,187	2014/2/15
1.25 T-NOTE 140315	1.25	3,700	3,743	340,797	2014/3/15
1.25 T-NOTE 140415	1.25	3,500	3,543	322,600	2014/4/15
1.25 T-NOTE 150831	1.25	4,300	4,397	400,327	2015/8/31
1.25 T-NOTE 150930	1.25	5,000	5,116	465,746	2015/9/30
1.25 T-NOTE 151031	1.25	4,600	4,708	428,633	2015/10/31
1.25 T-NOTE 191031	1.25	3,200	3,190	290,431	2019/10/31
1.375 T-NOTE 151130	1.375	4,300	4,417	402,147	2015/11/30
1.375 T-NOTE 180930	1.375	3,000	3,057	278,338	2018/9/30
1.375 T-NOTE 181130	1.375	3,000	3,052	277,858	2018/11/30
1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,500	2,541	231,361	2018/12/31
1.375 T-NOTE 190228	1.375	4,100	4,160	378,763	2019/2/28

銘柄名	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	
1.5 T-NOTE 131231	1.5	2,700	2,733	248,795	2013/12/31
1.5 T-NOTE 160630	1.5	3,900	4,031	366,971	2016/6/30
1.5 T-NOTE 160731	1.5	4,300	4,445	404,685	2016/7/31
1.5 T-NOTE 180831	1.5	2,200	2,259	205,663	2018/8/31
1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,800	1,837	167,310	2019/3/31
1.625 T-NOTE 221115	1.625	1,900	1,845	168,038	2022/11/15
1.75 T-NOTE 140131	1.75	3,100	3,149	286,668	2014/1/31
1.75 T-NOTE 140331	1.75	4,300	4,377	398,508	2014/3/31
1.75 T-NOTE 150731	1.75	5,700	5,897	536,889	2015/7/31
1.75 T-NOTE 160531	1.75	2,700	2,812	256,044	2016/5/31
1.75 T-NOTE 181031	1.75	4,500	4,680	426,020	2018/10/31
1.75 T-NOTE 220515	1.75	6,000	5,949	541,550	2022/5/15
1.875 T-NOTE 140228	1.875	4,800	4,887	444,948	2014/2/28
1.875 T-NOTE 140430	1.875	3,900	3,981	362,408	2014/4/30
1.875 T-NOTE 150630	1.875	3,800	3,941	358,764	2015/6/30
1.875 T-NOTE 170831	1.875	4,000	4,200	382,354	2017/8/31
1.875 T-NOTE 170930	1.875	2,700	2,834	257,993	2017/9/30
1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,625	238,971	2017/10/31
11.25 T-BOND 150215	11.25	940	1,150	104,687	2015/2/15
2 T-NOTE 160131	2.0	3,100	3,244	295,387	2016/1/31
2 T-NOTE 160430	2.0	2,500	2,623	238,784	2016/4/30
2 T-NOTE 211115	2.0	6,900	7,046	641,405	2021/11/15
2 T-NOTE 220215	2.0	10,000	10,173	926,088	2022/2/15
2.125 T-NOTE 141130	2.125	5,800	5,997	545,916	2014/11/30
2.125 T-NOTE 150531	2.125	5,100	5,312	483,566	2015/5/31
2.125 T-NOTE 151231	2.125	2,300	2,414	219,747	2015/12/31
2.125 T-NOTE 160229	2.125	1,000	1,051	95,730	2016/2/29
2.125 T-NOTE 210815	2.125	6,200	6,417	584,183	2021/8/15
2.25 T-NOTE 140531	2.25	4,800	4,929	448,738	2014/5/31
2.25 T-NOTE 150131	2.25	6,400	6,650	605,440	2015/1/31
2.25 T-NOTE 160331	2.25	2,500	2,641	240,429	2016/3/31
2.25 T-NOTE 171130	2.25	3,000	3,202	291,566	2017/11/30
2.25 T-NOTE 180731	2.25	2,300	2,457	223,714	2018/7/31
2.375 T-NOTE 140831	2.375	5,500	5,685	517,582	2014/8/31
2.375 T-NOTE 140930	2.375	5,200	5,383	490,052	2014/9/30
2.375 T-NOTE 141031	2.375	6,100	6,325	575,780	2014/10/31
2.375 T-NOTE 150228	2.375	5,300	5,528	503,283	2015/2/28
2.375 T-NOTE 160331	2.375	2,100	2,226	202,670	2016/3/31
2.375 T-NOTE 170731	2.375	3,200	3,431	312,346	2017/7/31
2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,700	1,827	166,339	2018/5/31
2.375 T-NOTE 180630	2.375	3,000	3,224	293,529	2018/6/30
2.5 T-NOTE 150331	2.5	6,300	6,600	600,841	2015/3/31
2.5 T-NOTE 150430	2.5	5,400	5,664	515,679	2015/4/30
2.5 T-NOTE 170630	2.5	3,000	3,231	294,158	2017/6/30
2.625 T-NOTE 140630	2.625	5,100	5,273	480,012	2014/6/30
2.625 T-NOTE 140731	2.625	4,700	4,869	443,233	2014/7/31
2.625 T-NOTE 141231	2.625	5,200	5,434	494,657	2014/12/31
2.625 T-NOTE 160229	2.625	1,800	1,920	174,850	2016/2/29
2.625 T-NOTE 160430	2.625	2,000	2,138	194,697	2016/4/30
2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,000	1,086	98,931	2018/1/31
2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,600	1,740	158,471	2018/4/30
2.625 T-NOTE 200815	2.625	5,500	5,958	542,400	2020/8/15
2.625 T-NOTE 201115	2.625	6,300	6,812	620,174	2020/11/15
2.75 T-BOND 420815	2.75	2,400	2,226	202,683	2042/8/15
2.75 T-NOTE 161130	2.75	3,700	4,000	364,150	2016/11/30
2.75 T-NOTE 170531	2.75	3,700	4,022	366,176	2017/5/31
2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,700	1,856	169,005	2017/12/31
2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,000	1,093	99,560	2018/2/28
2.75 T-NOTE 190215	2.75	5,900	6,470	589,043	2019/2/15
2.875 T-NOTE 180331	2.875	3,000	3,301	300,527	2018/3/31

国債証券

銘柄名	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	
3 T-NOTE 160831	3.0	3,000	3,260	296,814	2016/8/31
3 T-NOTE 160930	3.0	3,500	3,807	346,632	2016/9/30
3 T-NOTE 170228	3.0	3,400	3,720	338,711	2017/2/28
3.125 T-BOND 411115	3.125	2,700	2,717	247,413	2041/11/15
3.125 T-NOTE 161031	3.125	4,500	4,925	448,326	2016/10/31
3.125 T-NOTE 170131	3.125	3,800	4,173	379,883	2017/1/31
3.125 T-NOTE 170430	3.125	2,100	2,313	210,637	2017/4/30
3.125 T-NOTE 190515	3.125	6,300	7,056	642,352	2019/5/15
3.125 T-NOTE 210515	3.125	7,100	7,931	722,027	2021/5/15
3.25 T-NOTE 160531	3.25	2,100	2,292	208,666	2016/5/31
3.25 T-NOTE 160630	3.25	3,100	3,388	308,450	2016/6/30
3.25 T-NOTE 160731	3.25	4,000	4,378	398,540	2016/7/31
3.25 T-NOTE 161231	3.25	3,800	4,187	381,153	2016/12/31
3.25 T-NOTE 170331	3.25	3,400	3,761	342,410	2017/3/31
3.375 T-NOTE 191115	3.375	5,300	6,020	548,062	2019/11/15
3.5 T-BOND 390215	3.5	2,700	2,943	267,958	2039/2/15
3.5 T-NOTE 180215	3.5	4,400	4,970	452,475	2018/2/15
3.5 T-NOTE 200515	3.5	5,600	6,420	584,480	2020/5/15
3.625 T-NOTE 190815	3.625	5,800	6,680	608,098	2019/8/15
3.625 T-NOTE 200215	3.625	7,300	8,426	767,052	2020/2/15
3.625 T-NOTE 210215	3.625	6,800	7,867	716,206	2021/2/15
3.75 T-BOND 410815	3.75	3,700	4,188	381,254	2041/8/15
3.75 T-NOTE 181115	3.75	4,900	5,651	514,469	2018/11/15
3.875 T-BOND 400815	3.875	6,400	7,417	675,169	2040/8/15
3.875 T-NOTE 180515	3.875	2,000	2,305	209,888	2018/5/15
4 T-NOTE 140215	4.0	5,000	5,200	473,356	2014/2/15
4 T-NOTE 150215	4.0	4,200	4,517	411,209	2015/2/15
4 T-NOTE 180815	4.0	3,000	3,494	318,064	2018/8/15
4.125 T-NOTE 150515	4.125	3,400	3,694	336,353	2015/5/15
4.25 T-BOND 390515	4.25	2,800	3,450	314,104	2039/5/15
4.25 T-BOND 401115	4.25	6,300	7,759	706,377	2040/11/15
4.25 T-NOTE 140815	4.25	3,600	3,823	348,023	2014/8/15
4.25 T-NOTE 141115	4.25	3,000	3,213	292,515	2014/11/15
4.25 T-NOTE 150815	4.25	3,500	3,844	349,967	2015/8/15
4.25 T-NOTE 171115	4.25	2,700	3,136	285,489	2017/11/15
4.375 T-BOND 380215	4.375	1,800	2,255	205,316	2038/2/15
4.375 T-BOND 391115	4.375	3,900	4,898	445,879	2039/11/15
4.375 T-BOND 400515	4.375	6,000	7,537	686,095	2040/5/15
4.375 T-BOND 410515	4.375	5,700	7,161	651,912	2041/5/15
4.5 T-BOND 360215	4.5	2,000	2,546	231,792	2036/2/15
4.5 T-BOND 380515	4.5	2,100	2,680	244,038	2038/5/15
4.5 T-BOND 390815	4.5	1,900	2,431	221,378	2039/8/15
4.5 T-NOTE 151115	4.5	2,800	3,119	283,926	2015/11/15
4.5 T-NOTE 160215	4.5	2,500	2,806	255,506	2016/2/15
4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,900	2,206	200,832	2017/5/15
4.625 T-BOND 400215	4.625	4,900	6,392	581,951	2040/2/15
4.625 T-NOTE 161115	4.625	3,300	3,797	345,646	2016/11/15
4.625 T-NOTE 170215	4.625	2,700	3,129	284,856	2017/2/15
4.75 T-BOND 370215	4.75	800	1,055	96,093	2037/2/15
4.75 T-BOND 410215	4.75	5,500	7,317	666,080	2041/2/15
4.75 T-NOTE 140515	4.75	4,200	4,445	404,683	2014/5/15
4.75 T-NOTE 170815	4.75	2,900	3,419	311,277	2017/8/15
4.875 T-NOTE 160815	4.875	2,900	3,342	304,224	2016/8/15
5 T-BOND 370515	5.0	700	955	86,959	2037/5/15
5.125 T-NOTE 160515	5.125	2,000	2,301	209,539	2016/5/15
5.25 T-BOND 281115	5.25	1,400	1,884	171,558	2028/11/15
5.25 T-BOND 290215	5.25	1,400	1,888	171,897	2029/2/15
5.375 T-BOND 310215	5.375	2,200	3,051	277,759	2031/2/15
5.5 T-BOND 280815	5.5	1,000	1,377	125,422	2028/8/15
6 T-BOND 260215	6.0	1,200	1,698	154,628	2026/2/15

国債証券

銘柄名	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	6.125 T-BOND 271115	6.125	1,900	2,756	250,882	2027/11/15
	6.125 T-BOND 290815	6.125	1,000	1,475	134,326	2029/8/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	2,300	3,238	294,834	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	1,100	1,655	150,692	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	600	890	81,099	2026/11/15
	6.875 T-BOND 250815	6.875	1,100	1,659	151,075	2025/8/15
	7.125 T-BOND 230215	7.125	800	1,185	107,927	2023/2/15
	7.25 T-BOND 160515	7.25	2,600	3,173	288,913	2016/5/15
	7.25 T-BOND 220815	7.25	1,200	1,777	161,763	2022/8/15
	7.5 T-BOND 161115	7.5	2,100	2,644	240,701	2016/11/15
	7.5 T-BOND 241115	7.5	1,000	1,561	142,177	2024/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	1,700	2,584	235,269	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	1,600	2,302	209,585	2019/8/15
	8.75 T-BOND 170515	8.75	1,300	1,743	158,675	2017/5/15
8.75 T-BOND 200815	8.75	1,700	2,597	236,430	2020/8/15	
8.875 T-BOND 170815	8.875	1,400	1,908	173,769	2017/8/15	
8.875 T-BOND 190215	8.875	2,300	3,354	305,367	2019/2/15	
小計	-	-	-	-	71,867,299	-
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル			
国債証券	1 CAN GOVT 140201	1.0	1,000	999	90,262	2014/2/1
	1 CAN GOVT 141101	1.0	800	798	72,109	2014/11/1
	1 CAN GOVT 150201	1.0	1,500	1,496	135,152	2015/2/1
	1.5 CAN GOVT 150801	1.5	800	805	72,783	2015/8/1
	1.5 CAN GOVT 170301	1.5	1,900	1,907	172,289	2017/3/1
	1.5 CAN GOVT 170901	1.5	500	501	45,274	2017/9/1
	2 CAN GOVT 140301	2.0	1,100	1,110	100,351	2014/3/1
	2 CAN GOVT 141201	2.0	2,100	2,133	192,697	2014/12/1
	2 CAN GOVT 160601	2.0	1,100	1,124	101,584	2016/6/1
	2.25 CAN GOVT 140801	2.25	2,800	2,847	257,216	2014/8/1
	2.5 CAN GOVT 150601	2.5	1,400	1,443	130,353	2015/6/1
	2.75 CAN GOVT 160901	2.75	1,400	1,468	132,643	2016/9/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,600	1,710	154,536	2022/6/1
	3 CAN GOVT 140601	3.0	2,300	2,357	212,977	2014/6/1
	3 CAN GOVT 151201	3.0	1,500	1,573	142,111	2015/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,500	1,662	150,213	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,700	1,904	172,028	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	600	731	66,068	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	2,400	2,706	244,493	2019/6/1
	4 CAN GOVT 160601	4.0	1,800	1,957	176,855	2016/6/1
	4 CAN GOVT 170601	4.0	1,750	1,939	175,214	2017/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	2,000	2,596	234,541	2041/6/1
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,600	1,825	164,905	2018/6/1
	4.5 CAN GOVT 150601	4.5	1,800	1,938	175,100	2015/6/1
5 CAN GOVT 140601	5.0	1,800	1,892	170,988	2014/6/1	
5 CAN GOVT 370601	5.0	2,300	3,319	299,833	2037/6/1	
5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,600	2,332	210,729	2029/6/1	
5.75 CAN GOVT 330601	5.75	2,000	3,038	274,511	2033/6/1	
8 CAN GOVT 270601	8.0	900	1,532	138,474	2027/6/1	
9 CAN GOVT 250601	9.0	450	783	70,794	2025/6/1	
小計	-	-	-	-	4,737,097	-
(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	11,600	16,541	118,767	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,600	14,343	102,985	2036/11/20
	5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	5,000	5,042	36,206	2017/6/15
	6 MEXICAN BONOS 150618	6.0	11,000	11,363	81,592	2015/6/18
	6.25 MEXICAN BONO 160616	6.25	14,800	15,513	111,389	2016/6/16
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	13,900	15,273	109,662	2021/6/10
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	9,700	10,682	76,698	2022/6/9
	7 MEXICAN BONOS 140619	7.0	10,700	11,058	79,402	2014/6/19
	7.25 MEXICAN BONO 161215	7.25	8,700	9,474	68,026	2016/12/15

銘柄名	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	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	11,000	13,112	94,150	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	9,700	10,952	78,635	2017/12/14	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,600	11,582	83,160	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	2,000	2,440	17,520	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 151217	8.0	8,700	9,482	68,086	2015/12/17	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	10,500	12,508	89,809	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	3,600	4,447	31,934	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	6,100	7,233	51,939	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	14,100	18,258	131,097	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	14,200	18,618	133,677	2038/11/18	
9.5 MEXICAN BONOS 141218	9.5	16,900	18,420	132,260	2014/12/18		
小計	-	-	-	1,697,003	-		
(ユーロ)		千ユーロ	千ユーロ				
(ドイツ)	国債証券	0 SCHATS 140613	-	1,400	1,395	170,980	2014/6/13
		0 SCHATS 140912	-	1,200	1,195	146,429	2014/9/12
		0.25 SCHATS 140314	0.25	1,600	1,601	196,150	2014/3/14
		0.5 OBL 170407	0.5	2,600	2,593	317,725	2017/4/7
		0.5 OBL 171013	0.5	500	496	60,810	2017/10/13
		0.75 OBL 170224	0.75	2,200	2,218	271,782	2017/2/24
		1.25 OBL 161014	1.25	2,300	2,367	290,009	2016/10/14
		1.5 BUND 220904	1.5	1,000	993	121,681	2022/9/4
		1.75 BUND 220704	1.75	2,400	2,444	299,385	2022/7/4
		1.75 OBL 151009	1.75	2,400	2,492	305,264	2015/10/9
		2 BUND 220104	2.0	2,800	2,926	358,525	2022/1/4
		2 OBL 160226	2.0	2,000	2,100	257,277	2016/2/26
		2.25 BUND 200904	2.25	2,300	2,475	303,236	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	2,300	2,461	301,532	2021/9/4
		2.25 OBL 140411	2.25	2,400	2,458	301,178	2014/4/11
		2.25 OBL 150410	2.25	2,800	2,921	357,822	2015/4/10
		2.5 BUND 210104	2.5	2,800	3,061	374,988	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	600	611	74,897	2044/7/4
		2.5 OBL 141010	2.5	2,500	2,595	317,922	2014/10/10
		2.5 OBL 150227	2.5	2,500	2,616	320,464	2015/2/27
		2.75 OBL 160408	2.75	2,400	2,580	316,097	2016/4/8
		3 BUND 200704	3.0	3,300	3,729	456,886	2020/7/4
		3.25 BUND 150704	3.25	3,100	3,321	406,811	2015/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	3,200	3,664	448,842	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	2,800	3,222	394,692	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	2,200	2,604	318,981	2042/7/4
		3.5 BUND 160104	3.5	3,000	3,275	401,203	2016/1/4
		3.5 BUND 190704	3.5	3,000	3,471	425,217	2019/7/4
		3.75 BUND 150104	3.75	2,900	3,095	379,145	2015/1/4
		3.75 BUND 170104	3.75	3,000	3,378	413,844	2017/1/4
		3.75 BUND 190104	3.75	3,100	3,612	442,467	2019/1/4
		4 BUND 160704	4.0	3,500	3,924	480,718	2016/7/4
		4 BUND 180104	4.0	2,700	3,130	383,489	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	2,900	3,770	461,876	2037/1/4
		4.25 BUND 140104	4.25	3,200	3,321	406,901	2014/1/4
		4.25 BUND 140704	4.25	3,700	3,912	479,227	2014/7/4
		4.25 BUND 170704	4.25	2,900	3,362	411,825	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	2,700	3,194	391,311	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	2,000	2,739	335,573	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,400	1,884	230,785	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,800	3,946	483,367	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	2,000	2,958	362,411	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	2,500	3,696	452,768	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,800	2,616	320,459	2028/1/4
		6 BUND 160620	6.0	140	166	20,344	2016/6/20
		6.25 BUND 240104	6.25	1,300	1,889	231,482	2024/1/4

銘柄名	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	6.25 BUND 300104	6.25	1,200	1,885	230,932	2030/1/4
	6.5 BUND 270704	6.5	1,400	2,188	268,049	2027/7/4
(イタリア) 国債証券	2.5 ITALY GOVT 150301	2.5	2,000	2,032	248,911	2015/3/1
	3 ITALY GOVT 140401	3.0	2,200	2,244	274,988	2014/4/1
	3 ITALY GOVT 150415	3.0	3,100	3,177	389,249	2015/4/15
	3 ITALY GOVT 150615	3.0	2,700	2,769	339,222	2015/6/15
	3 ITALY GOVT 151101	3.0	2,500	2,567	314,508	2015/11/1
	3.5 ITALY GOVT 140601	3.5	2,900	2,982	365,291	2014/6/1
	3.75 ITALY GOVT 150801	3.75	3,800	3,964	485,616	2015/8/1
	3.75 ITALY GOVT 160415	3.75	2,300	2,413	295,602	2016/4/15
	3.75 ITALY GOVT 160801	3.75	4,100	4,300	526,792	2016/8/1
	3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	3,500	3,523	431,608	2021/3/1
	3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	4,100	4,122	504,920	2021/8/1
	4 ITALY GOVT 170201	4.0	3,600	3,797	465,128	2017/2/1
	4 ITALY GOVT 200901	4.0	3,900	4,011	491,397	2020/9/1
	4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,200	2,857	349,968	2037/2/1
	4.25 ITALY GOVT 140701	4.25	2,100	2,184	267,582	2014/7/1
	4.25 ITALY GOVT 140801	4.25	4,000	4,167	510,464	2014/8/1
	4.25 ITALY GOVT 150201	4.25	2,500	2,629	322,041	2015/2/1
	4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	3,100	3,272	400,793	2019/2/1
	4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	3,500	3,686	451,586	2019/9/1
	4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	3,500	3,661	448,457	2020/3/1
	4.5 ITALY GOVT 150715	4.5	500	530	64,984	2015/7/15
	4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	3,200	3,433	420,620	2018/2/1
	4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	3,200	3,430	420,189	2018/8/1
	4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	3,100	3,308	405,236	2019/3/1
	4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,900	3,082	377,528	2020/2/1
	4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	2,100	2,131	261,035	2026/3/1
	4.75 ITALY GOVT 160915	4.75	2,200	2,381	291,669	2016/9/15
	4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	2,300	2,486	304,532	2017/5/1
	4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,400	1,512	185,299	2017/6/1
	4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	3,600	3,857	472,470	2021/9/1
	4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	3,300	3,477	425,943	2023/8/1
	5 ITALY GOVT 220301	5.0	2,500	2,703	331,197	2022/3/1
	5 ITALY GOVT 250301	5.0	3,000	3,185	390,161	2025/3/1
5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,800	2,872	351,854	2034/8/1	
5 ITALY GOVT 390801	5.0	2,500	2,567	314,477	2039/8/1	
5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,800	2,868	351,374	2040/9/1	
5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	3,300	3,642	446,174	2017/8/1	
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	3,600	3,835	469,780	2029/11/1	
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	2,600	2,897	354,971	2022/9/1	
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,750	1,964	240,627	2033/2/1	
6 ITALY GOVT 141115	6.0	1,700	1,834	224,766	2014/11/15	
6 ITALY GOVT 310501	6.0	4,000	4,603	563,821	2031/5/1	
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	3,400	4,079	499,717	2027/11/1	
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,400	1,783	218,464	2026/11/1	
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,300	1,821	223,162	2023/11/1	
(フランス) 国債証券	0.75 BTAN 140925	0.75	1,500	1,511	185,131	2014/9/25
	1 BTAN 170725	1.0	500	500	61,287	2017/7/25
	1.75 BTAN 170225	1.75	3,200	3,313	405,902	2017/2/25
	2 BTAN 150712	2.0	4,000	4,150	508,431	2015/7/12
	2.25 BTAN 160225	2.25	3,100	3,257	399,008	2016/2/25
	2.25 O.A.T 221025	2.25	1,500	1,503	184,139	2022/10/25
	2.5 BTAN 140112	2.5	3,100	3,167	388,015	2014/1/12
	2.5 BTAN 150115	2.5	3,000	3,126	382,958	2015/1/15
	2.5 BTAN 160725	2.5	3,500	3,716	455,209	2016/7/25
	2.5 O.A.T 201025	2.5	3,900	4,105	502,934	2020/10/25
	3 BTAN 140712	3.0	4,400	4,574	560,352	2014/7/12
	3 O.A.T 151025	3.0	4,500	4,804	588,494	2015/10/25
	3 O.A.T 220425	3.0	3,900	4,189	513,157	2022/4/25

銘柄名	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
(フランス) 国債証券	3.25 O.A.T 160425	3.25	3,700	4,008	491,056	2016/4/25
	3.25 O.A.T 211025	3.25	3,900	4,290	525,577	2021/10/25
	3.5 O.A.T 150425	3.5	3,500	3,740	458,189	2015/4/25
	3.5 O.A.T 200425	3.5	3,900	4,389	537,687	2020/4/25
	3.5 O.A.T 260425	3.5	4,600	5,040	617,404	2026/4/25
	3.75 O.A.T 170425	3.75	4,400	4,921	602,849	2017/4/25
	3.75 O.A.T 191025	3.75	3,800	4,337	531,278	2019/10/25
	3.75 O.A.T 210425	3.75	4,100	4,681	573,497	2021/4/25
	4 O.A.T 140425	4.0	3,450	3,609	442,177	2014/4/25
	4 O.A.T 141025	4.0	3,000	3,191	390,969	2014/10/25
	4 O.A.T 180425	4.0	3,400	3,887	476,187	2018/4/25
	4 O.A.T 381025	4.0	3,150	3,633	445,128	2038/10/25
	4 O.A.T 550425	4.0	2,050	2,367	289,937	2055/4/25
	4 O.A.T 600425	4.0	1,200	1,387	169,903	2060/4/25
	4.25 O.A.T 171025	4.25	3,600	4,132	506,226	2017/10/25
	4.25 O.A.T 181025	4.25	3,300	3,838	470,144	2018/10/25
	4.25 O.A.T 190425	4.25	4,100	4,792	587,032	2019/4/25
	4.25 O.A.T 231025	4.25	4,400	5,186	635,240	2023/10/25
	4.5 O.A.T 410425	4.5	3,100	3,872	474,382	2041/4/25
	4.75 O.A.T 350425	4.75	2,700	3,431	420,299	2035/4/25
	5 O.A.T 161025	5.0	4,200	4,854	594,662	2016/10/25
	5.5 O.A.T 290425	5.5	2,800	3,774	462,291	2029/4/25
	5.75 O.A.T 321025	5.75	3,150	4,472	547,859	2032/10/25
	6 O.A.T 251025	6.0	2,300	3,164	387,600	2025/10/25
	8.5 O.A.T 191025	8.5	1,400	2,026	248,165	2019/10/25
	8.5 O.A.T 230425	8.5	1,300	2,042	250,153	2023/4/25
(オランダ) 国債証券	0.75 NETH GOVT 150415	0.75	1,300	1,311	160,654	2015/4/15
	1 NETH GOVT 140115	1.0	1,900	1,915	234,604	2014/1/15
	1.25 NETH GOVT 180115	1.25	800	812	99,486	2018/1/15
	2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,500	1,561	191,268	2022/7/15
	2.5 NETH GOVT 170115	2.5	2,100	2,248	275,440	2017/1/15
	2.5 NETH GOVT 330115	2.5	700	707	86,720	2033/1/15
	2.75 NETH GOVT 150115	2.75	2,300	2,409	295,179	2015/1/15
	3.25 NETH GOVT 150715	3.25	2,400	2,568	314,671	2015/7/15
	3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,300	2,596	318,083	2021/7/15
	3.5 NETH GOVT 200715	3.5	2,300	2,637	323,042	2020/7/15
	3.75 NETH GOVT 140715	3.75	2,200	2,312	283,261	2014/7/15
	3.75 NETH GOVT 230115	3.75	1,600	1,876	229,889	2023/1/15
	3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,700	2,141	262,331	2042/1/15
	4 NETH GOVT 160715	4.0	1,700	1,899	232,689	2016/7/15
	4 NETH GOVT 180715	4.0	2,000	2,312	283,233	2018/7/15
	4 NETH GOVT 190715	4.0	2,000	2,342	286,945	2019/7/15
	4 NETH GOVT 370115	4.0	1,800	2,297	281,456	2037/1/15
	4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,800	2,090	256,023	2017/7/15
	5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,800	2,546	311,937	2028/1/15
	(スペイン) 国債証券	3 SPAIN GOVT 150430	3.0	2,700	2,728	334,261
3.15 SPAIN GOVT 160131		3.15	2,800	2,816	344,944	2016/1/31
3.25 SPAIN GOVT 160430		3.25	2,900	2,916	357,227	2016/4/30
3.3 SPAIN GOVT 141031		3.3	2,900	2,956	362,130	2014/10/31
3.4 SPAIN GOVT 140430		3.4	2,000	2,039	249,830	2014/4/30
3.75 SPAIN GOVT 151031		3.75	1,300	1,331	163,074	2015/10/31
3.8 SPAIN GOVT 170131		3.8	2,700	2,738	335,452	2017/1/31
4 SPAIN GOVT 150730		4.0	2,800	2,890	354,049	2015/7/30
4 SPAIN GOVT 200430		4.0	2,900	2,826	346,162	2020/4/30
4.1 SPAIN GOVT 180730		4.1	2,500	2,527	309,547	2018/7/30
4.2 SPAIN GOVT 370131		4.2	2,000	1,610	197,208	2037/1/31
4.25 SPAIN GOVT 140131		4.25	1,700	1,746	213,876	2014/1/31
4.25 SPAIN GOVT 161031		4.25	2,700	2,787	341,454	2016/10/31
4.3 SPAIN GOVT 191031		4.3	2,400	2,409	295,137	2019/10/31
4.4 SPAIN GOVT 150131	4.4	2,700	2,810	344,315	2015/1/31	

銘柄名	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	4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	2,300	2,357	288,784	2019/7/30
	4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,900	1,768	216,637	2025/7/30
	4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,600	1,373	168,252	2041/7/30
	4.75 SPAIN GOVT 140730	4.75	2,200	2,288	280,324	2014/7/30
	4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,900	1,825	223,607	2024/1/31
	4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	2,600	2,639	323,298	2020/10/31
	4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,750	1,545	189,352	2040/7/30
	5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	2,600	2,806	343,713	2017/7/30
	5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	3,200	3,358	411,350	2021/4/30
	5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,900	1,930	236,512	2032/7/30
	5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,200	1,277	156,476	2022/1/31
	5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	800	830	101,730	2026/7/30
	6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,500	2,620	320,985	2029/1/31
	(ベルギー) 国債証券	2.75 BEL GOVT 160328	2.75	1,200	1,277	156,512
3 BEL GOVT 190928		3.0	600	651	79,796	2019/9/28
3.25 BEL GOVT 160928		3.25	1,850	2,013	246,627	2016/9/28
3.5 BEL GOVT 150328		3.5	1,500	1,597	195,714	2015/3/28
3.5 BEL GOVT 170628		3.5	1,200	1,326	162,436	2017/6/28
3.75 BEL GOVT 150928		3.75	1,150	1,246	152,738	2015/9/28
3.75 BEL GOVT 200928		3.75	2,300	2,611	319,901	2020/9/28
4 BEL GOVT 140328		4.0	1,700	1,773	217,187	2014/3/28
4 BEL GOVT 170328		4.0	1,700	1,909	233,835	2017/3/28
4 BEL GOVT 180328		4.0	1,400	1,594	195,348	2018/3/28
4 BEL GOVT 190328		4.0	1,500	1,723	211,083	2019/3/28
4 BEL GOVT 220328		4.0	1,900	2,192	268,525	2022/3/28
4 BEL GOVT 320328		4.0	300	341	41,829	2032/3/28
4.25 BEL GOVT 140928		4.25	1,700	1,809	221,653	2014/9/28
4.25 BEL GOVT 210928		4.25	1,900	2,230	273,179	2021/9/28
4.25 BEL GOVT 220928		4.25	1,800	2,107	258,096	2022/9/28
4.25 BEL GOVT 410328		4.25	1,600	1,900	232,819	2041/3/28
4.5 BEL GOVT 260328		4.5	900	1,080	132,322	2026/3/28
5 BEL GOVT 350328		5.0	2,400	3,116	381,757	2035/3/28
5.5 BEL GOVT 170928		5.5	1,300	1,559	190,988	2017/9/28
5.5 BEL GOVT 280328		5.5	2,400	3,198	391,811	2028/3/28
8 BEL GOVT 150328	8.0	900	1,045	128,061	2015/3/28	
(オーストリア) 国債証券	3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	300	324	39,690	2044/6/20
	3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	1,300	1,427	174,802	2017/2/20
	3.4 AUSTRIA GOVT 141020	3.4	1,500	1,580	193,564	2014/10/20
	3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	400	451	55,331	2022/11/22
	3.5 AUSTRIA GOVT 150715	3.5	1,700	1,828	223,985	2015/7/15
	3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	2,000	2,280	279,301	2021/9/15
	3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	1,100	1,267	155,226	2022/4/20
	3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,800	2,097	256,938	2020/7/15
	4 AUSTRIA GOVT 160915	4.0	1,400	1,567	191,987	2016/9/15
	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,650	2,073	254,009	2037/3/15
	4.3 AUSTRIA GOVT 140715	4.3	1,300	1,376	168,600	2014/7/15
	4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	1,000	1,154	141,408	2017/9/15
	4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,700	2,007	245,943	2019/3/15
	4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	1,700	2,000	245,090	2018/1/15
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,100	1,424	174,507	2026/3/15	
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	1,100	1,628	199,447	2027/7/15	
(フィンランド) 国債証券	1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	500	493	60,409	2022/9/15
	1.75 FINNISH GOVT 160415	1.75	1,100	1,145	140,290	2016/4/15
	1.875 FINNISH GOV 170415	1.875	300	314	38,531	2017/4/15
	2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	400	424	51,994	2028/7/4
	3.125 FINNISHGOVT 140915	3.125	1,000	1,046	128,234	2014/9/15
	3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	1,000	1,138	139,418	2020/4/15
	3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	800	919	112,587	2021/4/15
	3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	800	911	111,656	2017/9/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	900	1,091	133,656	2025/7/4	

銘柄名	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	4.25	600	656	80,417	2015/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	600	718	87,998	2019/7/4
(アイルランド) 国債証券	4.0	1,500	1,539	188,539	2014/1/15
4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	1,100	1,136	139,212	2019/6/18
4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	1,350	1,427	174,820	2018/10/18
4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,700	1,749	214,271	2020/4/18
4.6 IRISH GOVT 160418	4.6	1,300	1,394	170,805	2016/4/18
5 IRISH GOVT 201018	5.0	1,000	1,057	129,514	2020/10/18
5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,700	1,785	218,686	2025/3/13
5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	400	443	54,285	2017/10/18
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	700	783	95,929	2019/10/18
小計	—	—	—	71,968,853	—
(イギリス)		千イギリスポンド	千イギリスポンド		
1 GILT 170907	1.0	3,000	3,004	431,433	2017/9/7
1.75 GILT 170122	1.75	2,200	2,281	327,695	2017/1/22
1.75 GILT 220907	1.75	1,800	1,752	251,634	2022/9/7
2 GILT 160122	2.0	3,200	3,335	478,945	2016/1/22
2.25 GILT 140307	2.25	3,600	3,675	527,852	2014/3/7
2.75 GILT 150122	2.75	3,200	3,347	480,783	2015/1/22
3.75 GILT 190907	3.75	2,100	2,411	346,305	2019/9/7
3.75 GILT 200907	3.75	2,700	3,108	446,451	2020/9/7
3.75 GILT 210907	3.75	2,900	3,342	480,022	2021/9/7
3.75 GILT 520722	3.75	1,500	1,604	230,386	2052/7/22
4 GILT 160907	4.0	2,900	3,245	466,132	2016/9/7
4 GILT 220307	4.0	1,900	2,232	320,568	2022/3/7
4 GILT 600122	4.0	1,800	2,054	295,101	2060/1/22
4.25 GILT 271207	4.25	1,800	2,164	310,830	2027/12/7
4.25 GILT 320607	4.25	2,400	2,862	411,080	2032/6/7
4.25 GILT 360307	4.25	2,435	2,875	412,931	2036/3/7
4.25 GILT 390907	4.25	1,700	1,998	287,056	2039/9/7
4.25 GILT 401207	4.25	2,300	2,702	388,172	2040/12/7
4.25 GILT 461207	4.25	2,100	2,470	354,825	2046/12/7
4.25 GILT 491207	4.25	2,000	2,359	338,804	2049/12/7
4.25 GILT 551207	4.25	2,100	2,499	358,971	2055/12/7
4.5 GILT 190307	4.5	2,300	2,734	392,647	2019/3/7
4.5 GILT 340907	4.5	2,100	2,573	369,557	2034/9/7
4.5 GILT 421207	4.5	2,500	3,066	440,308	2042/12/7
4.75 GILT 150907	4.75	2,850	3,168	455,026	2015/9/7
4.75 GILT 200307	4.75	2,600	3,166	454,709	2020/3/7
4.75 GILT 301207	4.75	2,100	2,663	382,570	2030/12/7
4.75 GILT 381207	4.75	2,200	2,796	401,657	2038/12/7
5 GILT 140907	5.0	3,500	3,759	539,880	2014/9/7
5 GILT 180307	5.0	2,500	2,988	429,124	2018/3/7
5 GILT 250307	5.0	2,000	2,574	369,652	2025/3/7
6 GILT 281207	6.0	1,300	1,870	268,585	2028/12/7
8 GILT 151207	8.0	500	607	87,250	2015/12/7
8 GILT 210607	8.0	1,800	2,682	385,239	2021/6/7
8.75 GILT 170825	8.75	1,050	1,419	203,898	2017/8/25
小計	—	—	—	13,126,095	—
(スイス)		千スイスフラン	千スイスフラン		
2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	600	677	66,458	2020/7/6
2.5 SWISS GOVT 160312	2.5	1,000	1,074	105,463	2016/3/12
3 SWISS GOVT 180108	3.0	1,000	1,132	111,200	2018/1/8
3 SWISS GOVT 190512	3.0	800	931	91,386	2019/5/12
3.75 SWISS GOVT 150610	3.75	200	217	21,349	2015/6/10
4 SWISS GOVT 230211	4.0	600	787	77,313	2023/2/11
4 SWISS GOVT 280408	4.0	700	984	96,610	2028/4/8
4.25 SWISS GOVT 140106	4.25	600	623	61,216	2014/1/6
4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	800	939	92,227	2017/6/5
小計	—	—	—	723,226	—

銘柄名	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	%	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	千円		
国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	3,000	2,866	40,354	2023/11/13
	3 SWD GOVT 160712	3.0	6,400	6,798	95,727	2016/7/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	9,900	11,284	158,885	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	6,000	6,996	98,514	2039/3/30
	3.75 SWD GOVT 170812	3.75	7,500	8,306	116,956	2017/8/12
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	8,900	10,304	145,084	2019/3/12
	4.5 SWD GOVT 150812	4.5	8,700	9,459	133,187	2015/8/12
	5 SWD GOVT 201201	5.0	6,600	8,183	115,221	2020/12/1
6.75 SWD GOVT 140505	6.75	10,000	10,748	151,334	2014/5/5	
小計	-	-	-	-	1,055,267	-
(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	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	5,200	5,763	94,746	2021/5/25
	4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	6,100	6,681	109,836	2017/5/19
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,200	5,929	97,481	2019/5/22
	5 NORWE GOVT 150515	5.0	8,400	9,018	148,266	2015/5/15
小計	-	-	-	-	450,331	-
(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	2 DMK GOVT 141115	2.0	7,900	8,152	133,862	2014/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	12,100	13,721	225,305	2021/11/15
	4 DMK GOVT 151115	4.0	12,400	13,667	224,416	2015/11/15
	4 DMK GOVT 171115	4.0	7,800	9,018	148,081	2017/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	11,400	13,625	223,727	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	15,000	21,775	357,553	2039/11/15
	7 DMK GOVT 241110	7.0	3,200	5,045	82,851	2024/11/10
小計	-	-	-	-	1,395,798	-
(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	4.75 POLAND 161025	4.75	3,300	3,457	101,707	2016/10/25
	4.75 POLAND 170425	4.75	2,500	2,634	77,514	2017/4/25
	5 POLAND 160425	5.0	3,200	3,359	98,841	2016/4/25
	5.25 POLAND 171025	5.25	3,400	3,670	107,990	2017/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	3,700	4,081	120,065	2020/10/25
	5.5 POLAND 150425	5.5	5,100	5,334	156,943	2015/4/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	3,800	4,240	124,758	2019/10/25
	5.75 POLAND 140425	5.75	4,900	5,042	148,338	2014/4/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,900	2,168	63,796	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	4,200	4,833	142,203	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,000	1,198	35,248	2029/4/25
6.25 POLAND 151024	6.25	4,600	4,945	145,495	2015/10/24	
小計	-	-	-	-	1,322,904	-
(オーストラリア)		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
国債証券	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	500	467	44,368	2024/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	500	464	44,030	2029/4/21
	4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,400	1,485	140,859	2017/7/21
	4.5 AUST GOVT 141021	4.5	1,600	1,648	156,364	2014/10/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,300	2,511	238,204	2020/4/15
	4.75 AUST GOVT 151021	4.75	1,100	1,158	109,914	2015/10/21
	4.75 AUST GOVT 160615	4.75	2,000	2,129	201,999	2016/6/15
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	800	894	84,811	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	2,100	2,366	224,423	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,600	1,794	170,188	2018/1/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,500	1,781	168,930	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,600	3,086	292,697	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,800	2,161	204,967	2022/7/15
	6 AUST GOVT 170215	6.0	2,200	2,472	234,539	2017/2/15
	6.25 AUST GOVT 140615	6.25	1,800	1,886	178,930	2014/6/15
6.25 AUST GOVT 150415	6.25	1,800	1,936	183,679	2015/4/15	
小計	-	-	-	-	2,678,910	-
(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	0.25 SINGAPOREGOVT 140201	0.25	200	200	14,744	2014/2/1
	1.125 SINGAPOREGOVT 160401	1.125	200	205	15,123	2016/4/1

銘柄名	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	1.375SINGAPORGV 141001	1.375	500	509	37,536	2014/10/1
	2.25 SINGAPORGV 210601	2.25	200	215	15,902	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGV 170401	2.375	700	758	55,931	2017/4/1
	2.5 SINGAPORGV 190601	2.5	700	772	56,973	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGV 420401	2.75	300	306	22,577	2042/4/1
	2.875SINGAPORGV 150701	2.875	800	850	62,653	2015/7/1
	2.875SINGAPORGV 300901	2.875	400	437	32,276	2030/9/1
	3 SINGAPORGV 240901	3.0	500	568	41,874	2024/9/1
	3.125SINGAPORGV 220901	3.125	600	694	51,191	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGV 200901	3.25	700	807	59,496	2020/9/1
	3.5 SINGAPORGV 270301	3.5	600	706	52,067	2027/3/1
	3.625SINGAPORGV 140701	3.625	800	838	61,827	2014/7/1
	3.75 SINGAPORGV 160901	3.75	750	841	62,021	2016/9/1
	4 SINGAPORGV 180901	4.0	400	474	34,982	2018/9/1
小計	—	—	—	—	677,181	—
(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	1,100	1,093	32,591	2022/8/15
	3.434 MALAYSIAGOV 140815	3.434	900	905	26,996	2014/8/15
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	1,000	972	28,965	2027/5/31
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	400	404	12,053	2018/9/28
	3.741 MALAYSIAGOV 150227	3.741	1,700	1,722	51,336	2015/2/27
	3.814MALAYSIAGOV 170215	3.814	3,600	3,679	109,635	2017/2/15
	3.835MALAYSIAGOV 150812	3.835	1,900	1,933	57,620	2015/8/12
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	100	101	3,031	2027/3/15
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	2,300	2,373	70,727	2017/9/15
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	1,700	1,748	52,111	2032/4/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,400	1,468	43,756	2021/7/15
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,000	1,041	31,051	2018/2/7
	4.262MALAYSIAGOV 160915	4.262	4,000	4,147	123,594	2016/9/15
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	4,200	4,444	132,433	2019/11/29
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,200	1,287	38,366	2026/4/15
5.094MALAYSIAGOV 140430	5.094	3,000	3,076	91,674	2014/4/30	
5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	1,000	1,133	33,780	2019/7/30	
小計	—	—	—	—	939,728	—
(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	16,000	20,309	206,139	2026/12/21
	13.5 SOUTH AFRICA 150915	13.5	9,000	10,763	109,246	2015/9/15
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	9,000	7,208	73,167	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	5,500	4,467	45,348	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	11,100	11,277	114,468	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	6,000	5,483	55,660	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	11,800	12,392	125,784	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	2,000	2,130	21,624	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	10,900	11,909	120,877	2018/12/21
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	11,000	12,061	122,428	2017/9/15
	8.75 SOUTH AFRICA 141221	8.75	4,000	4,257	43,211	2014/12/21
8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	2,400	2,496	25,341	2048/2/28	
小計	—	—	—	—	1,063,299	—
合計	—	—	—	—	173,702,997	—

(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

2013年1月28日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	2,755,885	99.1
コール・ローン等、その他	23,853	0.9
投資信託財産総額	2,779,738	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(176,058,195千円)の投資信託財産総額(176,105,095千円)に対する比率は100.0%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=91.03円	1カナダドル=90.33円	1メキシコペソ=7.18円	1ユーロ=122.49円
1イギリスポンド=143.61円	1スイスフラン=98.16円	1スウェーデンクローネ=14.08円	1ノルウェークローネ=16.44円
1デンマーククローネ=16.42円	1ポーランドズロチ=29.42円	1オーストラリアドル=94.84円	1シンガポールドル=73.71円
1マレーシアリンギット=29.80円	1南アフリカランド=10.15円		

資産、負債、元本および基準価額の状況

2013年1月28日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,779,738,653円
コール・ローン等	23,542,712
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,755,885,097
未 収 入 金	310,783
未 収 利 息	61
(B) 負 債	23,488,919
未 払 解 約 金	16,006,715
未 払 信 託 報 酬	7,437,637
そ の 他 未 払 費 用	44,567
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,756,249,734
元 本	2,550,888,999
次 期 繰 越 損 益 金	205,360,735
(D) 受 益 権 総 口 数	2,550,888,999口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,805円

損益の状況

(2012年1月27日~2013年1月28日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	7,210円
受 取 利 息	7,210
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	467,560,998
売 買 益	526,625,514
売 買 損	△ 59,064,516
(C) 信 託 報 酬 等	△ 13,709,697
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	453,858,511
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 41,175,555
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 207,322,221
(配 当 等 相 当 額)	(84,548,879)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 291,871,100)
(G) 計 (D+E+F)	205,360,735
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	205,360,735
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 207,322,221
(配 当 等 相 当 額)	(87,354,360)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 294,676,581)
分 配 準 備 積 立 金	412,682,956

(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。

〈注記事項〉

- ①期首元本額 2,074,881,741円
 期中追加設定元本額 1,359,220,047円
 期中一部解約元本額 883,212,789円
- ②分配金の計算過程

		第 4 期
費用控除後の配当等収益額	A	65,407,743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	B	305,236,487円
収益調整金額	C	87,354,360円
分配準備積立金額	D	42,038,726円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	500,037,316円
当ファンドの期末残存口数	F	2,550,888,999口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F * 10,000$	1,960円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	$I=F * H / 10,000$	－円

分配金のお知らせ

◆ 収益分配金および分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税引前)

		第 4 期
当期分配金		－
当期の収益		－
当期の収益以外		－
翌期繰越分配対象額		1,960

◆「当期の収益」、「当期の収益以外」は小数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。

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

【お知らせ】

- ①委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載していますが、2013年6月21日以降は、以下の通り変更する予定です。
 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、「<http://www.am.mufg.jp/>」のアドレスに掲載します。
- ②投資信託約款に記載されていた「社団法人投資信託協会」を「一般社団法人投資信託協会」へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2013年1月4日)
- ③2013年1月1日から、2013年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税7%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、並びに地方税3%（法人受益者は7.147%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。
 なお、復興特別所得税に係る記載がされた目論見書の再交付をご希望される受益者の方につきましては、お申し出頂ければ再度、送付させていただきますので、その旨を販売会社までお申し出下さい。

外国債券インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2012年5月14日

[計算期間：2011年5月13日～2012年5月14日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月14日に第11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11期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	シティグループ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。投資成果をシティグループ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	シティグループ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。

当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準 価 額		シティグループ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比
	円	騰 落 率	騰 落 率	%		
(期 首) 2011年5月12日	13,067	—	73,213.13	%	%	%
5月末	13,188	0.9	73,441.25	0.3	98.5	—
6月末	13,141	0.6	73,208.49	△0.0	98.4	—
7月末	12,727	△2.6	71,079.16	△2.9	98.4	—
8月末	13,005	△0.5	72,663.73	△0.8	98.5	—
9月末	12,609	△3.5	70,653.56	△3.5	98.5	—
10月末	12,931	△1.0	72,441.61	△1.1	98.5	—
11月末	12,593	△3.6	70,331.32	△3.9	98.6	—
12月末	12,657	△3.1	70,618.10	△3.5	98.5	—
2012年1月末	12,681	△3.0	70,665.73	△3.5	98.5	—
2月末	13,624	4.3	75,886.43	3.7	98.6	—
3月末	13,753	5.2	76,501.98	4.5	98.7	—
4月末	13,597	4.1	75,963.13	3.8	98.5	—
(期 末) 2012年5月14日	13,365	2.3	74,734.13	2.1	98.7	—

(注) 基準価額は1万円当たり。

(注) 騰落率は期首比。

(注) シティグループ世界国債インデックス（除く日本）とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し指数化した債券インデックスです。シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、シティグループ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。

(注) 純資産総額は、期首158,541百万円、期末158,535百万円。

当期の運用経過

■ 基準価額の推移

基準価額は期首に比べ2.3%の上昇となりました。

基準価額の推移



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

■ 基準価額の変動要因

- ・当ファンドは、シティグループ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。
- ・ベンチマークであるシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）は期首と比べて2.1%の上昇となりました。基準価額はベンチマークにほぼ連動する形で推移しました。

債券市況の推移

(期首を100として指数化)

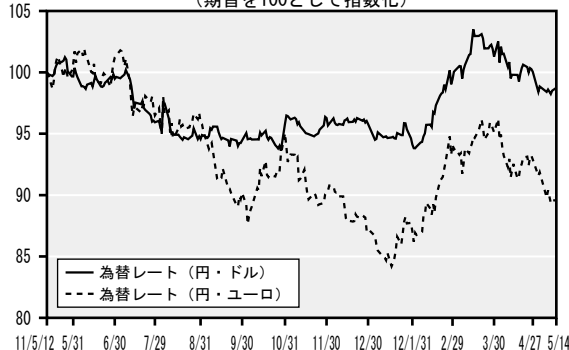


◎ 債券市況

- ・世界経済の先行き不透明感が強まったことや、欧州の債務問題に対する懸念などを背景とした「質への逃避」的な動きから、米国・ドイツなど主要国を中心に債券が買われ、金利は低下（債券価格は上昇）しました。

為替市況の推移

(期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・円・ドル相場は、米国の債務上限問題や格下げ懸念、FRB（米連邦準備制度理事会）による低金利政策が長期化するとの見方などが材料視され、ドルは対円で一時変動相場移行後の最安値を更新しました。期末にかけては、日銀による追加金融緩和の決定や米国経済の回復期待などを受けてドルが買い戻されましたが、結局、期首との比較では、ドルは対円で1.3%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、ECB（欧州中央銀行）が利下げに転じたことや、欧州債務問題に伴う域内周辺国の信用懸念、主要国の格下げ観測などを受けて、ユーロ売りが優勢でした。期首との比較では、ユーロは対円で10.4%下落しました。

◆ ベンチマークとの比較

ベンチマークとのカイ離は0.2%程度となりました。

	ポートフォリオ要因	管理コスト等要因	評価時価差異に基づく要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.1%程度	△0.0%程度	0.1%程度	0.2%程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.1%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、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。

(注) 為替の効果

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

債券の効果

保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◆ 今後の運用方針

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

1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 保 管 費 用 等	2円
合 計	2

(a) 保管費用等は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
 (注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況 (2011年5月13日～2012年5月14日)

■ 公社債

		買 付 額	売 付 額
外	アメリカ 国債証券	千アメリカドル 267,136	千アメリカドル 228,969
	カナダ 国債証券	千カナダドル 13,933	千カナダドル 15,957
	メキシコ 国債証券	千メキシコペソ 62,333	千メキシコペソ 51,847
	ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ 国債証券	42,946	46,803
	イタリア 国債証券	26,115	25,889
	フランス 国債証券	36,429	31,522
	オランダ 国債証券	9,224	7,037
	スペイン 国債証券	18,155	13,835
	ベルギー 国債証券	7,903	9,073
	オーストリア 国債証券	4,168	4,733
	フィンランド 国債証券	2,490	2,460
	アイルランド 国債証券	756	1,748
	ポルトガル 国債証券	—	10,802
国	イギリス 国債証券	千イギリスポンド 19,350	千イギリスポンド 25,774

		買 付 額	売 付 額
外	ス イ ス 国債証券	千スイスフラン 1,230	千スイスフラン 3,375
	スウェーデン 国債証券	千スウェーデンクローネ 10,881	千スウェーデンクローネ 21,905
	ノルウェー 国債証券	千ノルウェークローネ 11,428	千ノルウェークローネ 3,507
	デンマーク 国債証券	千デンマーククローネ 26,153	千デンマーククローネ 23,481
	ポーランド 国債証券	千ポーランドズロチ 12,335	千ポーランドズロチ 15,096
	オーストラリア 国債証券	千オーストラリアドル 8,552	千オーストラリアドル 1,859
	シンガポール 国債証券	千シンガポールドル 2,525	千シンガポールドル 2,612
	マレーシア 国債証券	千マレーシアリンギット 8,826	千マレーシアリンギット 10,203
	国		

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

組入資産の明細

■ 公社債

(A) 外国（外貨建）公社債の種類別開示

区 分	額 面 金 額	当 期		組入比率	うちBB格 以下組入比率	末		
		評 価 額				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 751,940	千アメリカドル 824,194	千円 66,042,731	% 41.7	% —	% 16.5	% 16.2	% 9.0
カ ナ ダ	千カナダドル 49,900	千カナダドル 57,205	4,587,285	2.9	—	1.4	1.0	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 217,000	千メキシコペソ 240,216	1,419,677	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	120,140	139,825	14,455,151	9.1	—	4.9	2.8	1.4
イ タ リ ア	139,750	136,017	14,061,458	8.9	—	5.3	2.7	0.9
フ ラ ン ス	132,300	145,756	15,068,343	9.5	—	5.3	3.0	1.2
オ ラ ン ダ	35,800	40,557	4,192,875	2.6	—	1.5	0.8	0.3

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
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%
ス ペ イ ン	68,450	64,550	6,673,268	4.2	—	2.1	1.5	0.7
ベ ル ギ ー	35,600	39,001	4,031,965	2.5	—	1.5	0.8	0.3
オーストリア	23,850	26,811	2,771,783	1.7	—	1.1	0.6	0.1
フィンランド	8,800	9,788	1,011,956	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	10,850	9,826	1,015,911	0.6	0.6	0.5	0.1	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 83,135	千イギリスポンド 98,140	12,638,546	8.0	—	5.7	1.9	0.4
ス イ ス	千スイスフラン 6,300	千スイスフラン 7,587	653,112	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローネ 69,300	千スウェーデンクローネ 81,355	934,769	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 34,400	千ノルウェークローネ 38,124	520,784	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 81,400	千デンマーククローネ 99,644	1,386,048	0.9	—	0.6	0.2	0.1
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 45,000	千ポーランドズロチ 45,654	1,115,327	0.7	—	0.3	0.2	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 26,900	千オーストラリアドル 29,879	2,402,930	1.5	—	0.7	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 8,950	千シンガポールドル 9,810	628,240	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 31,100	千マレーシアリンギット 32,103	837,266	0.5	—	0.2	0.3	0.1
合 計	—	—	156,449,438	98.7	0.6	49.3	33.5	15.9

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

(注) 組入比率は、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) 公社債の詳細開示(個別銘柄別)

2012年5月14日現在

銘 柄 名	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	0.125 T-NOTE 130831	0.125	4,900	4,893	392,084	2013/8/31
	0.125 T-NOTE 130930	0.125	4,800	4,792	384,038	2013/9/30
	0.125 T-NOTE 131231	0.125	5,000	4,989	399,820	2013/12/31
	0.25 T-NOTE 131031	0.25	5,000	5,000	400,696	2013/10/31
	0.25 T-NOTE 131130	0.25	5,500	5,500	440,732	2013/11/30
	0.25 T-NOTE 140131	0.25	5,000	5,000	400,665	2014/1/31
	0.25 T-NOTE 140228	0.25	6,000	5,999	480,761	2014/2/28
	0.25 T-NOTE 140331	0.25	5,800	5,799	464,717	2014/3/31
	0.25 T-NOTE 140915	0.25	5,400	5,393	432,144	2014/9/15
	0.25 T-NOTE 141215	0.25	5,000	4,990	399,914	2014/12/15
	0.25 T-NOTE 150115	0.25	5,000	4,988	399,757	2015/1/15
	0.25 T-NOTE 150215	0.25	5,000	4,985	399,507	2015/2/15
	0.375 T-NOTE 130630	0.375	5,000	5,008	401,322	2013/6/30
	0.375 T-NOTE 130731	0.375	6,300	6,311	505,726	2013/7/31
	0.375 T-NOTE 141115	0.375	5,000	5,006	401,197	2014/11/15
	0.375 T-NOTE 150315	0.375	2,000	2,001	160,341	2015/3/15
	0.375 T-NOTE 150415	0.375	5,200	5,201	416,822	2015/4/15
	0.5 T-NOTE 130531	0.5	4,900	4,914	393,817	2013/5/31
	0.5 T-NOTE 131015	0.5	4,800	4,817	386,006	2013/10/15
	0.5 T-NOTE 131115	0.5	3,200	3,212	257,377	2013/11/15
0.5 T-NOTE 140815	0.5	4,300	4,319	346,133	2014/8/15	

銘柄名	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	
0.5 T-NOTE 141015	0.5	4,000	4,018	321,972	2014/10/15
0.625 T-NOTE 130430	0.625	3,200	3,212	257,447	2013/4/30
0.625 T-NOTE 140715	0.625	5,000	5,036	403,545	2014/7/15
0.75 T-NOTE 130815	0.75	4,600	4,630	371,002	2013/8/15
0.75 T-NOTE 130915	0.75	4,500	4,530	363,049	2013/9/15
0.75 T-NOTE 131215	0.75	2,900	2,922	234,201	2013/12/15
0.75 T-NOTE 140615	0.75	4,900	4,947	396,471	2014/6/15
0.875 T-NOTE 161130	0.875	6,000	6,056	485,343	2016/11/30
0.875 T-NOTE 161231	0.875	3,000	3,026	242,474	2016/12/31
0.875 T-NOTE 170131	0.875	3,400	3,427	274,655	2017/1/31
0.875 T-NOTE 170228	0.875	4,300	4,333	347,223	2017/2/28
1 T-NOTE 130715	1.0	5,200	5,246	420,403	2013/7/15
1 T-NOTE 140115	1.0	2,000	2,024	162,231	2014/1/15
1 T-NOTE 140515	1.0	4,600	4,665	373,882	2014/5/15
1 T-NOTE 160831	1.0	4,500	4,573	366,486	2016/8/31
1 T-NOTE 160930	1.0	5,000	5,079	407,035	2016/9/30
1 T-NOTE 161031	1.0	5,200	5,280	423,154	2016/10/31
1 T-NOTE 170331	1.0	5,200	5,267	422,079	2017/3/31
1.125 T-NOTE 130615	1.125	4,700	4,745	380,274	2013/6/15
1.25 T-NOTE 140215	1.25	4,000	4,069	326,066	2014/2/15
1.25 T-NOTE 140315	1.25	3,700	3,767	301,912	2014/3/15
1.25 T-NOTE 140415	1.25	3,500	3,565	285,680	2014/4/15
1.25 T-NOTE 150831	1.25	4,300	4,417	353,953	2015/8/31
1.25 T-NOTE 150930	1.25	5,000	5,135	411,480	2015/9/30
1.25 T-NOTE 151031	1.25	4,600	4,722	378,417	2015/10/31
1.375 T-NOTE 130515	1.375	5,200	5,260	421,510	2013/5/15
1.375 T-NOTE 151130	1.375	4,300	4,434	355,353	2015/11/30
1.375 T-NOTE 180930	1.375	3,000	3,053	244,662	2018/9/30
1.375 T-NOTE 181130	1.375	3,000	3,047	244,183	2018/11/30
1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,500	2,538	203,376	2018/12/31
1.375 T-NOTE 190228	1.375	4,100	4,151	332,690	2019/2/28
1.5 T-NOTE 131231	1.5	3,700	3,774	302,480	2013/12/31
1.5 T-NOTE 160630	1.5	5,000	5,185	415,502	2016/6/30
1.5 T-NOTE 160731	1.5	4,300	4,459	357,345	2016/7/31
1.5 T-NOTE 180831	1.5	2,200	2,257	180,899	2018/8/31
1.75 T-NOTE 140131	1.75	3,100	3,178	254,710	2014/1/31
1.75 T-NOTE 140331	1.75	4,300	4,420	354,209	2014/3/31
1.75 T-NOTE 150731	1.75	3,700	3,857	309,093	2015/7/31
1.75 T-NOTE 160531	1.75	2,700	2,827	226,585	2016/5/31
1.75 T-NOTE 181031	1.75	4,500	4,680	375,036	2018/10/31
1.875 T-NOTE 140228	1.875	4,800	4,938	395,711	2014/2/28
1.875 T-NOTE 140430	1.875	3,900	4,021	322,272	2014/4/30
1.875 T-NOTE 150630	1.875	3,800	3,973	318,362	2015/6/30
1.875 T-NOTE 170831	1.875	3,000	3,159	253,188	2017/8/31
1.875 T-NOTE 170930	1.875	2,700	2,842	227,768	2017/9/30
1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,631	210,889	2017/10/31
11.25 T-BOND 150215	11.25	940	1,220	97,774	2015/2/15
2 T-NOTE 131130	2.0	4,500	4,620	370,275	2013/11/30
2 T-NOTE 160131	2.0	3,100	3,269	262,006	2016/1/31
2 T-NOTE 160430	2.0	2,500	2,641	211,671	2016/4/30
2 T-NOTE 211115	2.0	5,000	5,100	408,741	2021/11/15
2 T-NOTE 220215	2.0	9,000	9,154	733,565	2022/2/15
2.125 T-NOTE 141130	2.125	5,800	6,063	485,867	2014/11/30
2.125 T-NOTE 150531	2.125	5,100	5,367	430,101	2015/5/31
2.125 T-NOTE 151231	2.125	2,300	2,435	195,184	2015/12/31
2.125 T-NOTE 160229	2.125	1,000	1,060	84,969	2016/2/29
2.125 T-NOTE 210815	2.125	5,800	6,002	480,984	2021/8/15
2.25 T-NOTE 140531	2.25	4,800	4,992	400,023	2014/5/31
2.25 T-NOTE 150131	2.25	5,100	5,361	429,622	2015/1/31
2.25 T-NOTE 160331	2.25	2,500	2,665	213,596	2016/3/31
2.25 T-NOTE 171130	2.25	3,000	3,222	258,212	2017/11/30
2.25 T-NOTE 180731	2.25	5,000	5,362	429,728	2018/7/31
2.375 T-NOTE 140831	2.375	5,500	5,760	461,562	2014/8/31

銘柄	名	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	
	2.375 T-NOTE 140930	2.375	5,200	5,454	437,037	2014/9/30
	2.375 T-NOTE 141031	2.375	4,700	4,936	395,544	2014/10/31
	2.375 T-NOTE 150228	2.375	5,300	5,595	448,328	2015/2/28
	2.375 T-NOTE 160331	2.375	2,100	2,247	180,104	2016/3/31
	2.375 T-NOTE 170731	2.375	3,200	3,451	276,588	2017/7/31
	2.375 T-NOTE 180531	2.375	2,500	2,701	216,507	2018/5/31
	2.375 T-NOTE 180630	2.375	4,000	4,320	346,224	2018/6/30
	2.5 T-NOTE 150331	2.5	6,300	6,682	535,502	2015/3/31
	2.5 T-NOTE 150430	2.5	5,400	5,736	459,695	2015/4/30
	2.5 T-NOTE 170630	2.5	1,000	1,085	86,941	2017/6/30
	2.625 T-NOTE 140630	2.625	5,100	5,354	429,064	2014/6/30
	2.625 T-NOTE 140731	2.625	4,700	4,941	395,941	2014/7/31
	2.625 T-NOTE 141231	2.625	5,200	5,510	441,546	2014/12/31
	2.625 T-NOTE 160229	2.625	2,300	2,480	198,783	2016/2/29
	2.625 T-NOTE 160430	2.625	2,000	2,160	173,155	2016/4/30
	2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,000	1,094	87,736	2018/1/31
	2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,600	1,753	140,487	2018/4/30
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	8,500	9,240	740,409	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	6,300	6,834	547,649	2020/11/15
	2.75 T-NOTE 131031	2.75	4,100	4,249	340,532	2013/10/31
	2.75 T-NOTE 161130	2.75	3,700	4,042	323,893	2016/11/30
	2.75 T-NOTE 170531	2.75	3,700	4,059	325,318	2017/5/31
	2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,700	1,873	150,087	2017/12/31
	2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,000	1,102	88,352	2018/2/28
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	5,900	6,514	522,038	2019/2/15
	2.875 T-NOTE 180331	2.875	3,000	3,329	266,823	2018/3/31
	3 T-NOTE 160831	3.0	4,000	4,401	352,722	2016/8/31
	3 T-NOTE 160930	3.0	3,500	3,855	308,916	2016/9/30
	3 T-NOTE 170228	3.0	3,400	3,763	301,601	2017/2/28
	3.125 T-BOND 411115	3.125	2,700	2,762	221,354	2041/1/15
	3.125 T-NOTE 130430	3.125	2,900	2,981	238,876	2013/4/30
	3.125 T-NOTE 130831	3.125	3,700	3,838	307,575	2013/8/31
	3.125 T-NOTE 130930	3.125	3,500	3,639	291,607	2013/9/30
	3.125 T-NOTE 161031	3.125	4,500	4,985	399,516	2016/10/31
	3.125 T-NOTE 170131	3.125	3,800	4,224	338,511	2017/1/31
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	2,100	2,340	187,571	2017/4/30
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	6,700	7,567	606,412	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	7,100	7,979	639,416	2021/5/15
	3.25 T-NOTE 160531	3.25	2,900	3,208	257,130	2016/5/31
	3.25 T-NOTE 160630	3.25	3,100	3,434	275,213	2016/6/30
	3.25 T-NOTE 160731	3.25	4,000	4,437	355,601	2016/7/31
	3.25 T-NOTE 161231	3.25	3,800	4,241	339,891	2016/12/31
	3.25 T-NOTE 170331	3.25	3,400	3,807	305,092	2017/3/31
	3.375 T-NOTE 130630	3.375	2,500	2,588	207,445	2013/6/30
	3.375 T-NOTE 130731	3.375	2,900	3,010	241,236	2013/7/31
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	5,300	6,076	486,932	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	3,600	3,985	319,365	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 130531	3.5	2,900	2,999	240,346	2013/5/31
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	5,000	5,715	457,961	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	7,200	8,328	667,397	2020/5/15
	3.625 T-NOTE 130515	3.625	3,500	3,619	290,029	2013/5/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	5,800	6,752	541,111	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	9,700	11,305	905,873	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	6,800	7,933	635,705	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	3,700	4,257	341,184	2041/8/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	4,900	5,726	458,833	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	6,400	7,533	603,619	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	3,000	3,507	281,049	2018/5/15
	4 T-NOTE 140215	4.0	5,000	5,327	426,880	2014/2/15
	4 T-NOTE 150215	4.0	4,200	4,617	370,003	2015/2/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	3,000	3,542	283,885	2018/8/15
	4.125 T-NOTE 150515	4.125	3,400	3,778	302,761	2015/5/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	4,000	5,006	401,200	2039/5/15

国債証券

銘柄名	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	4.25 T-BOND 401115	4.25	6,300	7,889	632,167	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 130815	4.25	4,000	4,201	336,646	2013/8/15
	4.25 T-NOTE 131115	4.25	5,200	5,513	441,790	2013/11/15
	4.25 T-NOTE 140815	4.25	3,600	3,919	314,035	2014/8/15
	4.25 T-NOTE 141115	4.25	3,000	3,292	263,828	2014/11/15
	4.25 T-NOTE 150815	4.25	3,500	3,932	315,073	2015/8/15
	4.25 T-NOTE 171115	4.25	3,100	3,659	293,231	2017/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	2,000	2,550	204,331	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	5,500	7,021	562,669	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	6,000	7,661	613,933	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	5,700	7,283	583,665	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	2,600	3,361	269,341	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	2,600	3,376	270,546	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	4,200	5,465	437,983	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 151115	4.5	3,200	3,645	292,143	2015/11/15
	4.5 T-NOTE 160215	4.5	3,500	4,015	321,789	2016/2/15
	4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,900	2,248	180,186	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	5,800	7,694	616,597	2040/2/15
	4.625 T-NOTE 161115	4.625	3,300	3,878	310,807	2016/11/15
	4.625 T-NOTE 170215	4.625	2,700	3,192	255,835	2017/2/15
	4.75 T-BOND 370215	4.75	1,700	2,280	182,727	2037/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	5,500	7,443	596,480	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 140515	4.75	4,200	4,575	366,611	2014/5/15
	4.75 T-NOTE 170815	4.75	2,900	3,487	279,433	2017/8/15
	4.875 T-NOTE 160815	4.875	2,900	3,420	274,059	2016/8/15
	5 T-BOND 370515	5.0	2,100	2,916	233,689	2037/5/15
	5.125 T-NOTE 160515	5.125	2,000	2,360	189,119	2016/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	1,400	1,925	154,294	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	1,400	1,929	154,635	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	2,200	3,121	250,119	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	1,000	1,408	112,883	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	1,700	2,449	196,243	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	1,900	2,817	225,801	2027/11/15
6.125 T-BOND 290815	6.125	1,000	1,510	121,027	2029/8/15	
6.25 T-BOND 230815	6.25	2,500	3,579	286,856	2023/8/15	
6.25 T-BOND 300515	6.25	1,700	2,619	209,886	2030/5/15	
6.375 T-BOND 270815	6.375	900	1,359	108,975	2027/8/15	
6.5 T-BOND 261115	6.5	1,100	1,665	133,474	2026/11/15	
6.625 T-BOND 270215	6.625	1,000	1,534	122,980	2027/2/15	
6.875 T-BOND 250815	6.875	1,300	1,999	160,257	2025/8/15	
7.125 T-BOND 230215	7.125	1,300	1,964	157,409	2023/2/15	
7.25 T-BOND 160515	7.25	2,600	3,286	263,384	2016/5/15	
7.25 T-BOND 220815	7.25	1,200	1,813	145,315	2022/8/15	
7.5 T-BOND 161115	7.5	2,100	2,736	219,254	2016/11/15	
7.5 T-BOND 241115	7.5	1,000	1,593	127,713	2024/11/15	
7.625 T-BOND 250215	7.625	600	967	77,563	2025/2/15	
8 T-BOND 211115	8.0	1,700	2,648	212,249	2021/11/15	
8.125 T-BOND 190815	8.125	1,600	2,368	189,757	2019/8/15	
8.75 T-BOND 170515	8.75	1,300	1,811	145,185	2017/5/15	
8.75 T-BOND 200815	8.75	1,700	2,670	213,952	2020/8/15	
8.875 T-BOND 170815	8.875	1,400	1,984	159,017	2017/8/15	
8.875 T-BOND 190215	8.875	2,300	3,467	277,873	2019/2/15	
小計	-	-	-	-	66,042,731	-
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル			
国債証券	1 CAN GOVT 140201	1.0	1,000	995	79,794	2014/2/1
	1 CAN GOVT 150201	1.0	500	494	39,687	2015/2/1
	1.5 CAN GOVT 131101	1.5	1,600	1,604	128,704	2013/11/1
	1.5 CAN GOVT 170301	1.5	2,100	2,100	168,399	2017/3/1
	2 CAN GOVT 130801	2.0	1,600	1,614	129,439	2013/8/1
	2 CAN GOVT 140301	2.0	1,500	1,518	121,776	2014/3/1
	2 CAN GOVT 141201	2.0	2,100	2,133	171,061	2014/12/1
	2 CAN GOVT 160601	2.0	1,100	1,123	90,071	2016/6/1
	2.25 CAN GOVT 140801	2.25	1,300	1,326	106,341	2014/8/1

銘	柄	名	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	2.5 CAN GOVT 130901	2.5	1,200	1,218	97,750	2013/9/1
		2.5 CAN GOVT 150601	2.5	1,400	1,446	115,967	2015/6/1
		2.75 CAN GOVT 160901	2.75	1,100	1,158	92,868	2016/9/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	400	428	34,361	2022/6/1
		3 CAN GOVT 140601	3.0	2,300	2,378	190,715	2014/6/1
		3 CAN GOVT 151201	3.0	1,700	1,791	143,651	2015/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,500	1,672	134,135	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 130601	3.5	2,100	2,149	172,336	2013/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	2,000	2,258	181,101	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	500	616	49,463	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	2,800	3,184	255,344	2019/6/1
		4 CAN GOVT 160601	4.0	1,800	1,978	158,649	2016/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	1,750	1,959	157,121	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	2,000	2,634	211,220	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,800	2,072	166,173	2018/6/1
		4.5 CAN GOVT 150601	4.5	1,800	1,965	157,631	2015/6/1
		5 CAN GOVT 140601	5.0	1,800	1,933	155,072	2014/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	2,300	3,368	270,135	2037/6/1	
	5.25 CAN GOVT 130601	5.25	1,400	1,458	116,926	2013/6/1	
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,700	2,517	201,867	2029/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	2,200	3,390	271,854	2033/6/1	
	8 CAN GOVT 270601	8.0	900	1,558	124,947	2027/6/1	
	9 CAN GOVT 250601	9.0	650	1,156	92,713	2025/6/1	
小計						4,587,285	
(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	12,600	16,641	98,348	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,600	12,412	73,358	2036/11/20
		6 MEXICAN BONOS 150618	6.0	10,200	10,507	62,101	2015/6/18
		6.25 MEXICAN BONO 160616	6.25	9,800	10,202	60,294	2016/6/16
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	16,200	16,687	98,621	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	4,000	4,093	24,192	2022/6/9
		7 MEXICAN BONOS 140619	7.0	10,700	11,184	66,102	2014/6/19
		7.25 MEXICAN BONO 161215	7.25	7,700	8,354	49,377	2016/12/15
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	13,400	14,335	84,725	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	9,400	10,493	62,017	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	6,000	6,391	37,774	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	2,000	2,064	12,199	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 131219	8.0	16,200	17,033	100,670	2013/12/19
		8 MEXICAN BONOS 151217	8.0	6,600	7,240	42,792	2015/12/17
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	12,300	13,980	82,622	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	3,600	4,129	24,405	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	6,100	7,111	42,031	2018/12/13
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	14,100	16,316	96,428	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	14,200	15,961	94,330	2038/11/18	
	9 MEXICAN BONOS 130620	9.0	13,300	13,920	82,270	2013/6/20	
	9.5 MEXICAN BONOS 141218	9.5	19,000	21,152	125,010	2014/12/18	
小計						1,419,677	
(ユーロ)				千ユーロ	千ユーロ		
	国債証券	0.25 SCHATS 131213	0.25	2,200	2,206	228,061	2013/12/13
		0.25 SCHATS 140314	0.25	1,300	1,303	134,783	2014/3/14
		0.75 OBL 170224	0.75	1,000	1,010	104,496	2017/2/24
		0.75 SCHATS 130913	0.75	2,600	2,623	271,207	2013/9/13
		1.25 OBL 161014	1.25	2,700	2,795	289,048	2016/10/14
		1.75 BUND 220704	1.75	300	306	31,688	2022/7/4
		1.75 OBL 151009	1.75	2,400	2,523	260,852	2015/10/9
		1.75 SCHATS 130614	1.75	2,500	2,545	263,153	2013/6/14
		2 BUND 221014	2.0	3,200	3,362	347,621	2022/1/4
		2 OBL 160226	2.0	2,500	2,660	275,042	2016/2/26
		2.25 BUND 200904	2.25	2,300	2,489	257,342	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	2,300	2,473	255,678	2021/9/4
		2.25 OBL 140411	2.25	2,900	3,019	312,153	2014/4/11
		2.25 OBL 150410	2.25	2,800	2,967	306,730	2015/4/10
		2.5 BUND 210104	2.5	2,800	3,085	318,960	2021/1/4

銘柄名	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	2.5 OBL 141010	2.5	2,500	2,642	273,194	2014/10/10
	2.5 OBL 150227	2.5	2,500	2,661	275,171	2015/2/27
	2.75 OBL 160408	2.75	2,700	2,953	305,294	2016/4/8
	3 BUND 200704	3.0	3,300	3,768	389,563	2020/7/4
	3.25 BUND 150704	3.25	3,100	3,395	351,003	2015/7/4
	3.25 BUND 200104	3.25	3,200	3,708	383,349	2020/1/4
	3.25 BUND 210704	3.25	2,800	3,260	337,080	2021/7/4
	3.25 BUND 420704	3.25	2,100	2,579	266,715	2042/7/4
	3.5 BUND 160104	3.5	3,600	4,020	415,674	2016/1/4
	3.5 BUND 190704	3.5	3,500	4,103	424,245	2019/7/4
	3.75 BUND 130704	3.75	2,900	3,020	312,303	2013/7/4
	3.75 BUND 150104	3.75	3,500	3,831	396,131	2015/1/4
	3.75 BUND 170104	3.75	3,000	3,450	356,723	2017/1/4
	3.75 BUND 190104	3.75	3,600	4,261	440,535	2019/1/4
	4 BUND 160704	4.0	3,500	4,021	415,706	2016/7/4
	4 BUND 180104	4.0	3,200	3,783	391,090	2018/1/4
	4 BUND 370104	4.0	3,300	4,393	454,246	2037/1/4
	4 OBL 131011	4.0	2,400	2,532	261,782	2013/10/11
	4.25 BUND 140104	4.25	3,600	3,846	397,642	2014/1/4
	4.25 BUND 140704	4.25	3,700	4,026	416,281	2014/7/4
	4.25 BUND 170704	4.25	2,900	3,436	355,235	2017/7/4
	4.25 BUND 180704	4.25	3,000	3,619	374,199	2018/7/4
	4.25 BUND 390704	4.25	2,000	2,821	291,717	2039/7/4
	4.75 BUND 280704	4.75	1,700	2,289	236,677	2028/7/4
	4.75 BUND 340704	4.75	2,800	4,006	414,237	2034/7/4
	4.75 BUND 400704	4.75	2,400	3,665	378,916	2040/7/4
	5.5 BUND 310104	5.5	2,500	3,728	385,413	2031/1/4
	5.625 BUND 280104	5.625	2,200	3,208	331,658	2028/1/4
	6 BUND 160620	6.0	140	171	17,695	2016/6/20
	6.25 BUND 240104	6.25	1,600	2,357	243,670	2024/1/4
6.25 BUND 300104	6.25	1,400	2,217	229,291	2030/1/4	
6.5 BUND 270704	6.5	1,700	2,668	275,877	2027/7/4	
小計	-	-	-	-	14,455,151	-
(イタリア) 国債証券	2 ITALY GOVT 130601	2.0	2,500	2,488	257,248	2013/6/1
	2.25 ITALY GOVT 131101	2.25	2,700	2,684	277,493	2013/11/1
	2.5 ITALY GOVT 150301	2.5	500	485	50,206	2015/3/1
	3 ITALY GOVT 140401	3.0	2,200	2,200	227,515	2014/4/1
	3 ITALY GOVT 150415	3.0	3,100	3,049	315,238	2015/4/15
	3 ITALY GOVT 150615	3.0	2,700	2,651	274,115	2015/6/15
	3 ITALY GOVT 151101	3.0	2,500	2,440	252,273	2015/11/1
	3.5 ITALY GOVT 140601	3.5	3,200	3,218	332,718	2014/6/1
	3.75 ITALY GOVT 131215	3.75	2,900	2,940	303,999	2013/12/15
	3.75 ITALY GOVT 150801	3.75	3,800	3,809	393,845	2015/8/1
	3.75 ITALY GOVT 160415	3.75	2,300	2,283	236,097	2016/4/15
	3.75 ITALY GOVT 160801	3.75	4,100	4,054	419,153	2016/8/1
	3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	3,500	3,148	325,466	2021/3/1
	3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	4,100	3,653	377,699	2021/8/1
	4 ITALY GOVT 170201	4.0	3,600	3,564	368,539	2017/2/1
	4 ITALY GOVT 200901	4.0	3,900	3,608	373,023	2020/9/1
	4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,500	2,734	282,679	2037/2/1
	4.25 ITALY GOVT 130801	4.25	3,700	3,773	390,098	2013/8/1
	4.25 ITALY GOVT 140701	4.25	2,100	2,141	221,396	2014/7/1
	4.25 ITALY GOVT 140801	4.25	4,000	4,075	421,294	2014/8/1
	4.25 ITALY GOVT 150201	4.25	3,400	3,468	358,592	2015/2/1
	4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	3,400	3,285	339,629	2019/2/1
	4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	3,500	3,346	345,945	2019/9/1
	4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	3,500	3,320	343,250	2020/3/1
	4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	3,800	3,774	390,172	2018/2/1
	4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	3,600	3,552	367,236	2018/8/1
	4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	3,500	3,417	353,272	2019/3/1
	4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,900	2,797	289,218	2020/2/1
	4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	2,400	2,126	219,852	2026/3/1
	4.75 ITALY GOVT 160915	4.75	2,200	2,245	232,178	2016/9/15

銘柄名	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円			
(イタリア)	国債証券	4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	2,000	2,023	209,158	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	3,600	3,453	357,039	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	3,700	3,458	357,585	2023/8/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	2,500	2,418	249,972	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	3,000	2,819	291,516	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	3,300	2,939	303,865	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	2,700	2,377	245,756	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,800	2,459	254,250	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	3,300	3,406	352,207	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	3,900	3,654	377,781	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	400	397	41,048	2022/9/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,250	2,191	226,545	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 141115	6.0	1,700	1,804	186,536	2014/11/15
6 ITALY GOVT 310501	6.0	4,500	4,488	464,023	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	3,900	4,074	421,204	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,400	1,577	163,120	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,700	2,131	220,394	2023/11/1		
小計	-	-	-	-	14,061,458	-	
(フランス)	国債証券	1.75 BTAN 170225	1.75	1,200	1,206	124,763	2017/2/25
		2 BTAN 130925	2.0	2,200	2,248	232,496	2013/9/25
		2 BTAN 150712	2.0	4,000	4,129	426,876	2015/7/12
		2.25 BTAN 160225	2.25	3,100	3,216	332,511	2016/2/25
		2.5 BTAN 140112	2.5	4,300	4,444	459,514	2014/1/12
		2.5 BTAN 150115	2.5	3,100	3,241	335,139	2015/1/15
		2.5 BTAN 160725	2.5	3,500	3,655	377,859	2016/7/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	4,400	4,379	452,802	2020/10/25
		3 BTAN 140712	3.0	4,400	4,627	478,411	2014/7/12
		3 O.A.T 151025	3.0	4,900	5,217	539,412	2015/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	2,300	2,338	241,756	2022/4/25
		3.25 O.A.T 160425	3.25	4,300	4,625	478,207	2016/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	4,200	4,385	453,365	2021/10/25
		3.5 O.A.T 150425	3.5	3,500	3,767	389,528	2015/4/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	4,500	4,832	499,542	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	4,000	4,117	425,615	2026/4/25
		3.75 O.A.T 170425	3.75	4,400	4,836	499,949	2017/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	3,600	3,941	407,468	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	4,700	5,103	527,647	2021/4/25
		4 O.A.T 131025	4.0	3,500	3,681	380,590	2013/10/25
		4 O.A.T 140425	4.0	4,150	4,429	457,921	2014/4/25
		4 O.A.T 141025	4.0	3,000	3,240	335,028	2014/10/25
		4 O.A.T 180425	4.0	3,700	4,122	426,226	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	3,650	3,956	409,071	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	2,250	2,468	255,156	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,200	1,323	136,796	2060/4/25
		4.25 O.A.T 171025	4.25	3,000	3,378	349,217	2017/10/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	3,300	3,728	385,452	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	4,100	4,634	479,107	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	4,600	5,174	534,896	2023/10/25
4.5 BTAN 130712	4.5	3,200	3,353	346,678	2013/7/12		
4.5 O.A.T 410425	4.5	3,100	3,641	376,449	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	2,700	3,237	334,672	2035/4/25		
5 O.A.T 161025	5.0	4,200	4,834	499,781	2016/10/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	3,500	4,439	458,981	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	3,150	4,210	435,308	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	2,300	3,004	310,639	2025/10/25		
8.5 O.A.T 191025	8.5	1,400	1,992	205,975	2019/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	1,700	2,587	267,520	2023/4/25		
小計	-	-	-	-	15,068,343	-	
(オランダ)	国債証券	0.75 NETH GOVT 150415	0.75	800	806	83,357	2015/4/15
		1 NETH GOVT 140115	1.0	2,300	2,330	240,912	2014/1/15
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	1,800	1,922	198,765	2017/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	600	594	61,469	2033/1/15
2.75 NETH GOVT 150115	2.75	2,300	2,443	252,563	2015/1/15		

銘柄名	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円			
(オランダ)	国債証券	3.25 NETH GOVT 150715	3.25	2,700	2,929	302,809	2015/7/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,300	2,560	264,713	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	2,300	2,605	269,314	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 140715	3.75	2,200	2,364	244,391	2014/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	2,200	2,541	262,722	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,900	2,414	249,563	2042/1/15
		4 NETH GOVT 160715	4.0	2,000	2,260	233,680	2016/7/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	2,300	2,655	274,533	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	2,000	2,326	240,461	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,800	2,292	236,987	2037/1/15
		4.25 NETH GOVT 130715	4.25	2,300	2,408	249,032	2013/7/15
		4.5 NETH GOVT 170715	4.5	2,100	2,453	253,624	2017/7/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,900	2,650	273,969	2028/1/15
小計	-	-	-	-	4,192,875	-	
(スペイン)	国債証券	2.3 SPAIN GOVT 130430	2.3	2,100	2,086	215,730	2013/4/30
		2.5 SPAIN GOVT 131031	2.5	2,200	2,173	224,718	2013/10/31
		3 SPAIN GOVT 150430	3.0	2,700	2,607	269,593	2015/4/30
		3.15 SPAIN GOVT 160131	3.15	3,100	2,946	304,630	2016/1/31
		3.25 SPAIN GOVT 160430	3.25	2,700	2,558	264,513	2016/4/30
		3.3 SPAIN GOVT 141031	3.3	2,600	2,561	264,809	2014/10/31
		3.4 SPAIN GOVT 140430	3.4	2,000	1,987	205,426	2014/4/30
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	2,400	2,272	234,924	2017/1/31
		4 SPAIN GOVT 150730	4.0	2,000	1,974	204,165	2015/7/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,900	2,595	268,292	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	2,400	2,235	231,128	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 130730	4.2	2,200	2,226	230,210	2013/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,400	1,756	181,580	2037/1/31
		4.25 SPAIN GOVT 140131	4.25	2,100	2,122	219,464	2014/1/31
		4.25 SPAIN GOVT 161031	4.25	2,000	1,939	200,505	2016/10/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	2,400	2,211	228,610	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 150131	4.4	3,300	3,329	344,224	2015/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	2,500	2,358	243,834	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,200	1,879	194,321	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,600	1,248	129,026	2041/7/30
		4.75 SPAIN GOVT 140730	4.75	2,200	2,240	231,643	2014/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	2,700	2,388	246,942	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	2,600	2,429	251,209	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,750	1,402	145,021	2040/7/30
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	2,000	2,022	209,117	2017/7/30
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	3,200	3,108	321,404	2021/4/30
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,200	2,037	210,685	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	500	494	51,087	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,000	954	98,681	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,500	2,396	247,763	2029/1/31		
小計	-	-	-	-	6,673,268	-	
(ベルギー)	国債証券	2.75 BEL GOVT 160328	2.75	1,500	1,563	161,621	2016/3/28
		3.25 BEL GOVT 160928	3.25	1,850	1,959	202,575	2016/9/28
		3.5 BEL GOVT 150328	3.5	1,500	1,593	164,746	2015/3/28
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	900	958	99,089	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 150928	3.75	1,750	1,883	194,691	2015/9/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	2,500	2,645	273,504	2020/9/28
		4 BEL GOVT 140328	4.0	1,700	1,797	185,851	2014/3/28
		4 BEL GOVT 170328	4.0	1,700	1,854	191,712	2017/3/28
		4 BEL GOVT 180328	4.0	1,400	1,524	157,627	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	1,500	1,629	168,483	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	2,800	2,994	309,581	2022/3/28
		4.25 BEL GOVT 130928	4.25	2,300	2,413	249,520	2013/9/28
		4.25 BEL GOVT 140928	4.25	1,900	2,041	211,025	2014/9/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,900	2,068	213,834	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,200	1,299	134,290	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,800	1,952	201,798	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	500	554	57,288	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	2,400	2,858	295,501	2035/3/28

銘柄名	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	5.5 BEL GOVT 170928	1,300	1,513	156,515	2017/9/28
		5.5 BEL GOVT 280328	2,300	2,825	292,105	2028/3/28
		8 BEL GOVT 150328	900	1,069	110,599	2015/3/28
小計	—	—	—	—	4,031,965	—
(オーストリア)	国債証券	3.2 AUSTRIA GOVT 170220	1,600	1,730	178,930	2017/2/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 141020	1,500	1,602	165,653	2014/10/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	200	214	22,167	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 150715	1,700	1,841	190,394	2015/7/15
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	2,000	2,178	225,213	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	1,600	1,757	181,717	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 131020	1,900	1,992	206,007	2013/10/20
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	1,800	2,015	208,376	2020/7/15
		4 AUSTRIA GOVT 160915	1,800	2,010	207,827	2016/9/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,650	1,921	198,611	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 140715	1,300	1,405	145,300	2014/7/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	1,000	1,137	117,636	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	1,700	1,951	201,738	2019/3/15
	4.65 AUSTRIA GOVT 180115	1,700	1,967	203,390	2018/1/15	
	4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,500	1,829	189,131	2026/3/15	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	900	1,254	129,686	2027/7/15	
小計	—	—	—	—	2,771,783	—
(フィンランド)	国債証券	1.75 FINNISH GOVT 160415	1,100	1,147	118,613	2016/4/15
		2.75 FINNISH GOVT 280704	400	412	42,658	2028/7/4
		3.125 FINNISH GOVT 140915	1,000	1,067	110,363	2014/9/15
		3.375 FINNISH GOVT 200415	1,000	1,123	116,152	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	800	907	93,807	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT 170915	1,300	1,486	153,652	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	900	1,066	110,296	2025/7/4
		4.25 FINNISH GOVT 150704	600	670	69,350	2015/7/4
		4.375 FINNISH GOVT 190704	800	952	98,483	2019/7/4
	5.375 FINNISH GOVT 130704	900	953	98,577	2013/7/4	
小計	—	—	—	—	1,011,956	—
(アイルランド)	国債証券	4 IRISH GOVT 140115	1,500	1,464	151,418	2014/1/15
		4.4 IRISH GOVT 190618	1,100	955	98,752	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	1,350	1,199	123,952	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	1,700	1,456	150,535	2020/4/18
		4.6 IRISH GOVT 160418	1,500	1,437	148,557	2016/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	1,000	880	91,005	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	1,700	1,493	154,357	2025/3/13
	5.9 IRISH GOVT 191018	1,000	941	97,332	2019/10/18	
小計	—	—	—	—	1,015,911	—
ユーロ計	—	—	—	—	63,282,715	—
(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	200	198	25,597	2017/9/7
		1.75 GILT 170122	2,900	3,003	386,738	2017/1/22
		2 GILT 160122	4,300	4,496	579,088	2016/1/22
		2.25 GILT 140307	3,900	4,030	518,991	2014/3/7
		2.75 GILT 150122	3,400	3,602	463,926	2015/1/22
		3.75 GILT 190907	3,000	3,467	446,551	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3,000	3,470	446,976	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3,600	4,174	537,623	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	500	543	70,004	2052/7/22
		4 GILT 160907	3,300	3,741	481,878	2016/9/7
		4 GILT 220307	1,900	2,243	288,981	2022/3/7
		4 GILT 600122	1,800	2,089	269,078	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	1,900	2,292	295,270	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	2,500	2,979	383,667	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	2,735	3,246	418,024	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	1,900	2,251	289,972	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	2,600	3,080	396,653	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	2,300	2,748	354,011	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	2,300	2,754	354,751	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	2,400	2,902	373,838	2055/12/7

銘柄名	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
国債証券	4.5 GILT 190307	4.5	2,300	2,767	356,380	2019/3/7
	4.5 GILT 340907	4.5	2,300	2,828	364,214	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	2,300	2,851	367,221	2042/12/7
	4.75 GILT 150907	4.75	2,450	2,785	358,704	2015/9/7
	4.75 GILT 200307	4.75	3,100	3,817	491,676	2020/3/7
	4.75 GILT 301207	4.75	2,400	3,048	392,521	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	2,500	3,200	412,192	2038/12/7
	5 GILT 140907	5.0	3,800	4,201	541,016	2014/9/7
	5 GILT 180307	5.0	2,500	3,039	391,410	2018/3/7
	5 GILT 250307	5.0	2,500	3,241	417,392	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	1,700	2,467	317,705	2028/12/7
	8 GILT 130927	8.0	1,000	1,103	142,147	2013/9/27
	8 GILT 151207	8.0	1,000	1,261	162,462	2015/12/7
	8 GILT 210607	8.0	1,800	2,738	352,724	2021/6/7
8.75 GILT 170825	8.75	1,050	1,468	189,151	2017/8/25	
小計	-	-	-	-	12,638,546	-
(スイス)		千スイスフラン	千スイスフラン			
国債証券	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	600	684	58,959	2020/7/6
	2.5 SWISS GOVT 160312	2.5	900	982	84,608	2016/3/12
	3 SWISS GOVT 180108	3.0	1,000	1,155	99,452	2018/1/8
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	900	1,063	91,514	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	700	937	80,695	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	800	1,157	99,679	2028/4/8
	4.25 SWISS GOVT 140106	4.25	600	642	55,278	2014/1/6
	4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	800	963	82,923	2017/6/5
小計	-	-	-	-	653,112	-
(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	3 SWD GOVT 160712	3.0	7,000	7,543	86,670	2016/7/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	7,900	9,354	107,483	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	6,400	8,484	97,490	2039/3/30
	3.75 SWD GOVT 170812	3.75	7,500	8,488	97,532	2017/8/12
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	10,000	11,912	136,872	2019/3/12
	4.5 SWD GOVT 150812	4.5	8,700	9,652	110,901	2015/8/12
	5 SWD GOVT 201201	5.0	9,600	12,351	141,920	2020/12/1
6.75 SWD GOVT 140505	6.75	12,200	13,568	155,897	2014/5/5	
小計	-	-	-	-	934,769	-
(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	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	5,500	6,282	85,820	2021/5/25
	4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	6,100	6,889	94,116	2017/5/19
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,000	5,865	80,115	2019/5/22
	5 NORWE GOVT 150515	5.0	7,800	8,595	117,410	2015/5/15
	6.5 NORWE GOVT 130515	6.5	10,000	10,492	143,320	2013/5/15
小計	-	-	-	-	520,784	-
(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	2 DMK GOVT 141115	2.0	7,500	7,823	108,821	2014/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	10,600	12,072	167,933	2021/11/15
	4 DMK GOVT 151115	4.0	12,400	13,956	194,130	2015/11/15
	4 DMK GOVT 171115	4.0	7,800	9,142	127,175	2017/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	12,900	15,596	216,941	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	15,800	23,652	329,007	2039/11/15
	5 DMK GOVT 131115	5.0	10,600	11,363	158,069	2013/11/15
7 DMK GOVT 241110	7.0	3,800	6,036	83,967	2024/11/10	
小計	-	-	-	-	1,386,048	-
(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	4.75 POLAND 161025	4.75	3,100	3,073	75,089	2016/10/25
	5 POLAND 131024	5.0	6,200	6,216	151,867	2013/10/24
	5 POLAND 160425	5.0	2,800	2,807	68,575	2016/4/25
	5.25 POLAND 171025	5.25	3,900	3,943	96,339	2017/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	4,000	3,988	97,426	2020/10/25
	5.5 POLAND 150425	5.5	5,100	5,193	126,885	2015/4/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	4,200	4,280	104,581	2019/10/25
	5.75 POLAND 140425	5.75	4,900	4,988	121,873	2014/4/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,000	1,027	25,096	2021/10/25

銘柄名	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	5.75 POLAND 220923	5.75	4,200	4,312	105,360	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,000	1,016	24,828	2029/4/25
	6.25 POLAND 151024	6.25	4,600	4,805	117,403	2015/10/24
小計	—	—	—	—	1,115,327	—
(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	4.25 AUST GOVT 170721	4.25	700	746	60,000	2017/7/21
	4.5 AUST GOVT 141021	4.5	1,600	1,667	134,134	2014/10/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,300	2,524	203,048	2020/4/15
	4.75 AUST GOVT 151021	4.75	600	639	51,462	2015/10/21
	4.75 AUST GOVT 160615	4.75	2,000	2,155	173,314	2016/6/15
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	600	677	54,459	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	2,300	2,617	210,533	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 131215	5.5	1,400	1,459	117,374	2013/12/15
	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,200	1,360	109,433	2018/1/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,100	1,310	105,374	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,900	3,473	279,322	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,400	1,695	136,326	2022/7/15
	6 AUST GOVT 170215	6.0	2,200	2,514	202,186	2017/2/15
	6.25 AUST GOVT 140615	6.25	1,800	1,928	155,095	2014/6/15
6.25 AUST GOVT 150415	6.25	2,200	2,420	194,662	2015/4/15	
6.5 AUST GOVT 130515	6.5	2,600	2,688	216,201	2013/5/15	
小計	—	—	—	—	2,402,930	—
(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	0.25 SINGAPORGOVT 140201	0.25	200	200	12,820	2014/2/1
	1.125SINGAPORGOVT 160401	1.125	200	206	13,198	2016/4/1
	1.375SINGAPORGOVT 141001	1.375	500	513	32,916	2014/10/1
	2.25 SINGAPORGOVT 130701	2.25	900	920	58,975	2013/7/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	400	425	27,255	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGOVT 170401	2.375	700	762	48,811	2017/4/1
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	400	435	27,883	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	200	202	12,996	2042/4/1
	2.875SINGAPORGOVT 150701	2.875	600	648	41,529	2015/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	400	436	27,944	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	556	35,657	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	400	453	29,046	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	700	798	51,162	2020/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	600	698	44,720	2027/3/1
	3.625SINGAPORGOVT 140701	3.625	800	858	54,963	2014/7/1
	3.75 SINGAPORGOVT 160901	3.75	750	857	54,909	2016/9/1
	4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	700	834	53,447	2018/9/1
小計	—	—	—	—	628,240	—
(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		
国債証券	3.21 MALAYSIAGOV 130531	3.21	200	200	5,222	2013/5/31
	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	300	296	7,731	2022/8/15
	3.434 MALAYSIAGOV 140815	3.434	2,300	2,316	60,415	2014/8/15
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	1,000	954	24,894	2027/5/31
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	400	403	10,522	2018/9/28
	3.741 MALAYSIAGOV 150227	3.741	1,700	1,722	44,927	2015/2/27
	3.814MALAYSIAGOV 170215	3.814	5,300	5,410	141,099	2017/2/15
	3.835MALAYSIAGOV 150812	3.835	2,300	2,340	61,051	2015/8/12
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	2,300	2,372	61,873	2017/9/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,400	1,459	38,075	2021/7/15
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,000	1,041	27,168	2018/2/7
	4.262MALAYSIAGOV 160915	4.262	4,000	4,163	108,578	2016/9/15
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	4,200	4,429	115,521	2019/11/29
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	700	733	19,138	2026/4/15
	5.094MALAYSIAGOV 140430	5.094	3,000	3,114	81,235	2014/4/30
5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	1,000	1,143	29,812	2019/7/30	
小計	—	—	—	—	837,266	—
合計	—	—	—	—	156,449,438	—

(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

2012年5月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	156,449,438	98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,267,798	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	158,717,236	100.0

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売相場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、1アメリカドル=80.13円、1カナダドル=80.19円、1メキシコペソ=5.91円、1ユーロ=103.38円、1イギリスポンド=128.78円、1スイスフラン=86.08円、1スウェーデンクローネ=11.49円、1ノルウェークローネ=13.66円、1デンマーククローネ=13.91円、1ポーランドズロチ=24.43円、1オーストラリアドル=80.42円、1シンガポールドル=64.04円、1マレーシアリンギット=26.08円です。
 (注) 期末における外貨建純資産(158,486,835千円)の投資信託財産総額(158,717,236千円)に対する比率は99.9%です。

資産、負債、元本および基準価額の状況

2012年5月14日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	158,791,465,844円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	376,079,170
公 社 債 (評価額)	156,449,438,642
未 収 入 金	189,022,364
未 収 利 息	1,716,225,899
前 払 費 用	60,699,769
(B) 負 債	255,938,812
未 払 金	74,237,940
未 払 解 約 金	181,700,872
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	158,535,527,032
元 本	118,623,380,022
次 期 繰 越 損 益 金	39,912,147,010
(D) 受 益 権 総 口 数	118,623,380,022口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	13,365円

損益の状況

(2011年5月13日～2012年5月14日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	5,157,263,279円
受 取 利 息	5,157,263,279
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,248,916,451
売 買 益	9,143,758,701
売 買 損	△ 10,392,675,152
(C) 保 管 費 用 等	△ 18,861,625
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	3,889,485,203
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	37,214,364,162
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,068,419,781
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 5,260,122,136
(H) 計 (D + E + F + G)	39,912,147,010
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	39,912,147,010

(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。

〈注記事項〉

①期首元本額	121,327,213,157円
期中追加設定元本額	14,429,809,676円
期中一部解約元本額	17,133,642,811円
②期末における元本の内訳	
ファンド・マネジャー（海外債券）	108,342,741円
eMAXIS 先進国債券インデックス	1,495,725,599円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	20,942,210円
eMAXIS バランス（波乗り型）	11,024,355円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	3,947,866,504円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	38,147,603,468円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	5,454,344,847円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	3,901,233,267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）	2,932,420,837円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	35,933,753,062円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	8,416,353,194円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,959,483,416円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	525,200,644円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	293,112,799円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	4,058,174,305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）	23,930,696円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	49,291,058円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	82,072,307円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	92,160,202円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	41,727,957円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	2,496,442,586円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	473,034,663円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	914,488,755円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	904,578,078円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	1,062,619,307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）	2,008,276,343円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,953,622,176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）	257,120,140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）	609,939,428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）	349,784,947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）	98,710,131円
合計	118,623,380,022円



三菱UFJ投信より
基準価額・分配金をメール配信
<http://k.m-muam.jp/a/1/3>

*メール配信対象外ファンドもあります。

