

運用報告書 (全体版)

第2期<決算日2017年10月12日>

たわらノーロード 先進国債券

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	2015年12月18日から無期限です。	
運用方針	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要投資対象	たわらノーロード 先進国債券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%未満とします。	
分配方針	決算日 (原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額を分配対象額とし、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「たわらノーロード 先進国債券」は、2017年10月12日に第2期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

たわらノーロード 先進国債券

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期騰落 中率	期騰落 中率	騰落率			
(設定日) 2015年12月18日	円	円	%	ポイント (12月17日)	%	%	%	百万円
	10,000	-	-	117,821.69	-	-	-	1
1期 (2016年10月12日)	8,876	0	△11.2	103,992.55	△11.7	97.4	-	707
2期 (2017年10月12日)	9,836	0	10.8	115,318.15	10.9	96.8	-	1,920

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) ベンチマークはシティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています (以下同じ)。

(注5) シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します (以下同じ)。

(注6) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		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) 2016年10月12日	円	%	ポイント	%	%	%
	8,876	-	103,992.55	-	97.4	-
10月末	8,878	0.0	103,797.35	△0.2	97.1	-
11月末	9,233	4.0	108,026.33	3.9	96.5	-
12月末	9,519	7.2	111,331.80	7.1	97.8	-
2017年1月末	9,290	4.7	108,860.69	4.7	96.6	-
2月末	9,239	4.1	108,568.93	4.4	97.3	-
3月末	9,239	4.1	108,641.98	4.5	96.8	-
4月末	9,294	4.7	109,024.53	4.8	96.9	-
5月末	9,432	6.3	110,685.94	6.4	97.7	-
6月末	9,608	8.2	112,709.17	8.4	98.3	-
7月末	9,601	8.2	112,671.90	8.3	98.2	-
8月末	9,736	9.7	114,354.58	10.0	98.0	-
9月末	9,843	10.9	115,558.22	11.1	97.8	-
(期末) 2017年10月12日	9,836	10.8	115,318.15	10.9	96.8	-

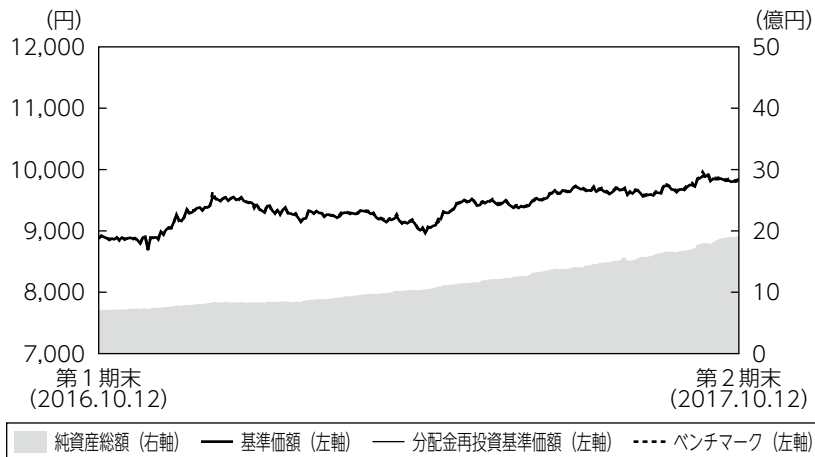
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2016年10月13日から2017年10月12日まで）

基準価額等の推移



第2期首： 8,876円
第2期末： 9,836円
(既払分配金0円)
騰落率： 10.8%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

米国大統領選挙でトランプ氏が当選後、米国の財政支出の拡大観測が強まったこと、ユーロ圏のインフレ率が予想比で上振れたこと、欧米の中央銀行の関係者が利上げを示唆するコメントを発表したことなどが債券利回りの上昇（価格の下落）要因となった一方、主要通貨に対して円安が進む要因となりました。主要通貨に対して円安が大幅に進んだことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

外国債券市場では債券利回りは上昇しました。期初から2016年11月にかけては英国のEU（欧州連合）離脱に対する過度な懸念が後退したほか、米国の利上げ観測や欧州の量的緩和縮小観測から利回りは上昇しました。その後も米国大統領選挙でトランプ氏が当選し財政支出拡大観測が強まったこと、ユーロ圏のインフレ率が市場予想よりも高かったことなどを背景にして、米国、欧州ともに利回りが上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。対ドルでは、トランプ政権の経済政策や税制改革への期待、また、米国の利上げに対する期待が高まったことなどを背景にして円安が進みました。一方、対ユーロでもユーロ圏のインフレ率が市場予想よりも高かったことなどを背景にして、ECB（欧州中央銀行）による金融政策正常化観測が強まり、円安が進みました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

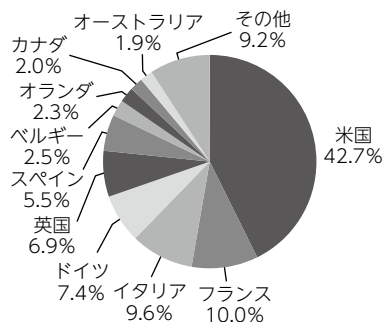
●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

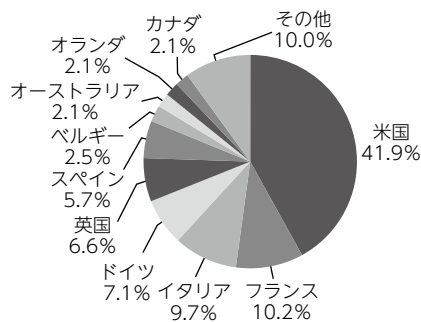
【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○国別配分

期首（前期末）



期末



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

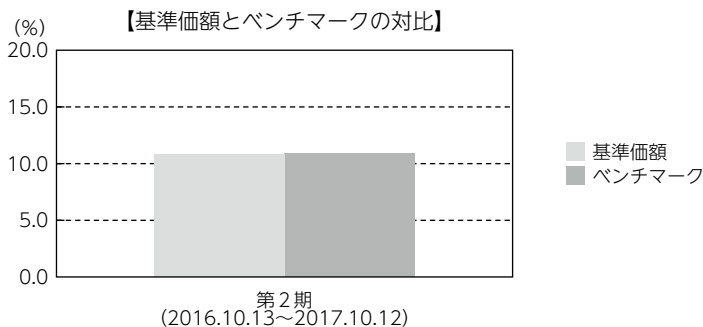
(注3) 上位11位以下をその他に含めて集計しています。

(注4) 発行国（地域）を表示しています。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で10.9%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%となり、信託報酬の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2016年10月13日 ～2017年10月12日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	475円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■1万口当たりの費用明細

項目	第2期		項目の概要
	(2016年10月13日 ～2017年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	20円	0.216%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,392円です。
(投信会社)	(9)	(0.094)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(9)	(0.094)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.027)	受託銀行分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	2	0.017	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.010)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用
合計	22	0.233	

(注1) 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・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用はこのファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2016年10月13日から2017年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 670,410	千円 1,191,850	千□ 57,018	千円 101,850

■利害関係人との取引状況等（2016年10月13日から2017年10月12日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 425,744	千□ 1,039,135	千円 1,918,036

■投資信託財産の構成

2017年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,918,036	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,075	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,923,112	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2017年10月12日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは239,472,056千円、99.5%です。

(注3) 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、2017年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.45円、1カナダ・ドル=90.34円、1オーストラリア・ドル=87.76円、1シンガポール・ドル=83.07円、1イギリス・ポンド=148.93円、1スイス・フラン=115.52円、1デンマーク・クローネ=17.92円、1ノルウェー・クローネ=14.21円、1スウェーデン・クローナ=13.99円、1メキシコ・ペソ=6.01円、1マレーシア・リングギット=26.69円、1南アフリカ・ランド=8.32円、1ポーランド・ズロチ=31.24円、1ユーロ=133.43円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,923,112,661円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,075,878
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,918,036,783
(B) 負 債	2,955,933
未 払 解 約 金	1,380,563
未 払 信 託 報 酬	1,544,557
そ の 他 未 払 費 用	30,813
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,920,156,728
元 本	1,952,182,219
次 期 繰 越 損 益 金	△32,025,491
(D) 受 益 権 総 口 数	1,952,182,219口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,836円

(注) 期首における元本額は797,518,058円、当期中における追加設定元本額は1,711,127,763円、同解約元本額は556,463,602円です。

■損益の状況

当期 自2016年10月13日 至2017年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△3,134円
受 取 利 息	652
支 払 利 息	△3,786
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	98,723,881
売 買 益 損	120,199,713
買 買 損 益	△21,475,832
(C) 信 託 報 酬 等	△2,507,527
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	96,213,220
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△23,561,445
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△104,677,266
(配 当 等 相 当 額)	(18,678,755)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△123,356,021)
(G) 合 計(D+E+F)	△32,025,491
次 期 繰 越 損 益 金(G)	△32,025,491
追 加 信 託 差 損 益 金	△104,677,266
(配 当 等 相 当 額)	(20,208,232)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△124,885,498)
分 配 準 備 積 立 金	72,651,775

(注1) (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2) (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3) (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4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	29,809,857円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	37,269,718
(c) 収 益 調 整 金	20,208,232
(d) 分 配 準 備 積 立 金	5,572,200
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	92,860,007
(f) 1万口当たり当期分配対象額	475.67
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■当ファンドが投資対象とする「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第14期（決算日 2017年2月21日）

（計算期間 2016年2月23日～2017年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月10日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		シティ世界国債インデックス		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（ベンチマーク）	期中騰落率			
10期（2013年2月21日）	14,505	22.4%	90,963.34	22.6%	98.0%	-	407,015
11期（2014年2月21日）	16,392	13.0%	102,469.19	12.6%	97.6%	-	383,685
12期（2015年2月23日）	18,820	14.8%	117,697.87	14.9%	97.5%	-	345,838
13期（2016年2月22日）	17,881	△5.0%	111,769.89	△5.0%	97.6%	-	267,780
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9%	108,792.68	△2.7%	97.9%	-	248,485

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）ベンチマークはシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注3）シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		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) 2016 年 2 月 22 日	円 17,881	% -	ポイント 111,769.89	% -	% 97.6	% -
2 月 末	17,848	△0.2	111,665.54	△0.1	97.3	-
3 月 末	18,166	1.6	113,814.63	1.8	97.6	-
4 月 末	17,591	△1.6	109,994.30	△1.6	96.5	-
5 月 末	17,748	△0.7	111,018.87	△0.7	97.1	-
6 月 末	16,765	△6.2	104,838.51	△6.2	97.3	-
7 月 末	17,040	△4.7	106,568.17	△4.7	96.9	-
8 月 末	16,916	△5.4	105,873.31	△5.3	97.4	-
9 月 末	16,594	△7.2	103,925.95	△7.0	97.5	-
10 月 末	16,623	△7.0	103,797.35	△7.1	97.2	-
11 月 末	17,292	△3.3	108,026.33	△3.3	96.6	-
12 月 末	17,831	△0.3	111,331.80	△0.4	98.0	-
2017 年 1 月 末	17,406	△2.7	108,860.69	△2.6	96.7	-
(期 末) 2017 年 2 月 21 日	17,364	△2.9	108,792.68	△2.7	97.9	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2016年2月23日から2017年2月21日）



基準価額の推移

当期末の基準価額は17,364円となり、前期末比で2.9%下落しました。

基準価額の主な変動要因

トランプ新大統領が選出されたことから米国の財政拡大期待が強まったほか、インフレ期待により債券利回りが上昇（価格は下落）したことがマイナスに寄与し、基準価額は下落しました。



投資環境

外国債券市場では、2016年2月から5月にかけては米欧の金利はほぼ横ばいとなりましたが、6月に入り、EU（欧州連合）離脱を問う英国国民投票で離脱が支持を獲得したことで世界的にリスク回避の動きが強まり、欧州を中心に債券利回りは急低下しました。11月に米国大統領選挙でトランプ氏が当選し、米国の財政支出の拡大観測とともにインフレに対する期待が強まり米国金利が大きく上昇したほか、欧州の金利も米国に連れて上昇しました。

為替市場では、期初から2016年5月にかけてのドル／円相場は米国の利上げ観測と日銀の追加緩和が遠ざかったとの見方から1ドル＝110円を挟むボックス圏での取引となりました。6月から8月にかけては英国のEU離脱によるリスク回避の動きから円高が進みました。その後はトランプ新大統領による財政政策への期待から米国金利が上昇したことで再びドルが買われ、期末には1ドル＝113.43円となりました。

ポートフォリオについて

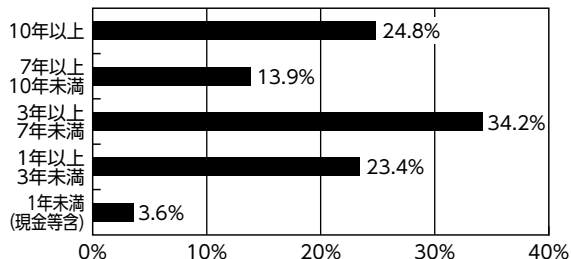
ベンチマークとリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

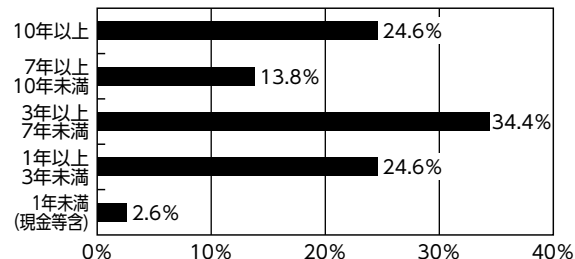
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債 インデックス	差	
北米	米国	43.4%	-1.0%	
	カナダ	2.0%	-0.0%	
	計	45.4%	-1.1%	
中南米	メキシコ	1.0%	-0.1%	
	計	1.0%	-0.1%	
欧州	オーストリア	1.6%	-0.1%	
	ベルギー	2.6%	-0.0%	
	フィンランド	0.6%	-0.0%	
	フランス	9.7%	-0.0%	
	ドイツ	7.4%	0.0%	
	アイルランド	0.8%	-0.1%	
	イタリア	9.6%	-0.1%	
	オランダ	2.4%	-0.0%	
	スペイン	5.4%	-0.1%	
	ユーロ計	40.0%	40.4%	-0.4%
	デンマーク	0.6%	0.6%	-0.0%
	スウェーデン	0.4%	0.5%	-0.0%
スイス	0.0%	0.3%	-0.3%	
英国	7.8%	8.0%	-0.2%	
ポーランド	0.5%	0.6%	-0.0%	
ノルウェー	0.2%	0.3%	-0.0%	
	計	50.7%	-1.1%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	1.7%	-0.1%	
	シンガポール	0.3%	-0.0%	
	マレーシア	0.4%	-0.1%	
	計	2.6%	-0.2%	
アフリカ	南アフリカ	0.4%	-0.0%	
	計	0.4%	-0.0%	
現金など	2.4%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	

期末

国	当ファンド	世界国債 インデックス	差	
北米	米国	44.3%	-0.1%	
	カナダ	2.2%	-0.0%	
	計	46.5%	-0.2%	
中南米	メキシコ	0.8%	-0.0%	
	計	0.8%	-0.0%	
欧州	オーストリア	1.5%	-0.1%	
	ベルギー	2.4%	-0.1%	
	フィンランド	0.6%	-0.1%	
	フランス	9.6%	-0.3%	
	ドイツ	7.2%	7.3%	-0.1%
	アイルランド	0.7%	0.8%	-0.1%
	イタリア	9.2%	9.5%	-0.2%
	オランダ	2.2%	2.3%	-0.1%
	スペイン	5.4%	5.6%	-0.2%
	ユーロ計	38.7%	39.9%	-1.2%
	デンマーク	0.6%	0.6%	-0.1%
	スウェーデン	0.4%	0.5%	-0.1%
スイス	0.0%	0.2%	-0.2%	
英国	7.1%	7.2%	-0.1%	
ポーランド	0.6%	0.6%	-0.1%	
ノルウェー	0.2%	0.3%	-0.1%	
	計	49.3%	-1.7%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	2.1%	-0.0%	
	シンガポール	0.4%	-0.0%	
	マレーシア	0.4%	-0.1%	
	計	2.9%	-0.1%	
アフリカ	南アフリカ	0.5%	-0.0%	
	計	0.5%	-0.0%	
現金など	2.1%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	

(注) 世界国債インデックスとはシティ世界国債インデックス（除く日本）です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.7%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.2%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることなどが挙げられます。

今後の運用方針

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) そ の 他 費 用	2円	0.013%
（保管費用）	(2)	(0.010)
（その他）	(1)	(0.003)
合計	2	0.013

(注) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,230円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については5ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2016年2月23日から2017年2月21日まで)
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 339,971	千アメリカ・ドル 335,541	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 21,106	千カナダ・ドル 20,243	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 15,199	千オーストラリア・ドル 11,431	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,467	千シンガポール・ドル 1,402	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 14,538	千イギリス・ポンド 22,250	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 13,685	千デンマーク・クローネ 21,991	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 5,214	千ノルウェー・クローネ 13,859	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 7,820	千スウェーデン・クローナ 15,390	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 62,625	千メキシコ・ペソ 76,168	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 13,460	千マレーシア・リンギット 16,872	
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 20,233	千南アフリカ・ランド 10,334	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 13,015	千ポーランド・ズロチ 8,581	
国	ユ ー ロ 圏	アイルランド	国債証券	千ユーロ 1,684	千ユーロ 2,409
		オランダ	国債証券	6,705	12,101
		ベルギー	国債証券	7,696	10,420
		フランス	国債証券	29,387	28,364
		ドイツ	国債証券	24,263	30,601
		スペイン	国債証券	18,586	20,859
		イタリア	国債証券	31,046	33,535
		フィンランド	国債証券	2,163	2,967
オーストリア	国債証券	3,019	6,355		

(注) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等 (2016年2月23日から2017年2月21日まで)
期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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 950,710	千アメリカ・ドル 968,150	千円 109,817,254	% 44.2	% -	% 18.7	% 17.1	% 8.3	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 55,860	千カナダ・ドル 61,995	千円 5,360,132	2.2	-	1.0	0.6	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 54,750	千オーストラリア・ドル 58,784	千円 5,117,750	2.1	-	1.4	0.6	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,240	千シンガポール・ドル 10,796	千円 861,776	0.3	-	0.2	0.1	0.1	
イギリス	千イギリス・ポンド 97,530	千イギリス・ポンド 124,590	千円 17,615,840	7.1	-	5.1	1.7	0.2	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 66,870	千デンマーク・クローネ 84,683	千円 1,368,483	0.6	-	0.3	0.2	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 36,460	千ノルウェー・クローネ 39,224	千円 532,665	0.2	-	0.1	0.1	-	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 68,480	千スウェーデン・クローナ 79,352	千円 1,004,603	0.4	-	0.3	0.1	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 325,000	千メキシコ・ペソ 335,623	千円 1,866,066	0.8	-	0.4	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 37,430	千マレーシア・リンギット 37,399	千円 951,449	0.4	-	0.2	0.1	0.1	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 160,740	千南アフリカ・ランド 147,896	千円 1,283,738	0.5	-	0.4	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 48,470	千ポーランド・ズロチ 50,085	千円 1,393,392	0.6	-	0.2	0.3	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	13,210	15,060	1,808,709	0.7	-	0.4	0.3	0.0	
オランダ	37,700	44,820	5,382,883	2.2	-	1.3	0.6	0.2	
ベルギー	41,100	50,562	6,072,509	2.4	-	1.8	0.5	0.1	
フランス	167,580	198,374	23,824,769	9.6	-	6.0	2.8	0.7	
ドイツ	124,040	149,120	17,909,398	7.2	-	4.1	2.3	0.9	
スペイン	95,200	111,854	13,433,709	5.4	-	3.1	1.7	0.6	
イタリア	166,080	191,072	22,947,823	9.2	-	5.8	2.6	0.9	
フィンランド	10,010	11,373	1,365,933	0.5	-	0.4	0.2	0.0	
オーストリア	23,140	28,286	3,397,178	1.4	-	0.9	0.4	-	
合 計	-	-	千円 243,316,068	97.9	-	52.2	32.7	13.0	

(注1) 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2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当	期				末		
		種	利	額	評		額	
					類			率
				金額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.125 01/31/21	国債証券	2.1250	8,000	8,116	920,625	2021/01/31		
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	5,000	4,900	555,892	2023/01/31		
US T N/B 1.375 01/31/20	国債証券	1.3750	2,000	1,994	226,256	2020/01/31		
US T N/B 1.25 01/31/20	国債証券	1.2500	10,800	10,729	1,217,093	2020/01/31		
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	3,200	4,136	469,200	2026/02/15		
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,800	1,834	208,096	2042/02/15		
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	4,600	4,679	530,742	2043/02/15		
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	7,000	6,255	709,582	2046/02/15		
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	2,000	2,192	248,747	2039/02/15		
US T N/B 8.875 02/15/19	国債証券	8.8750	4,000	4,610	523,016	2019/02/15		
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	3,300	4,402	499,334	2031/02/15		
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	2,000	2,532	287,304	2036/02/15		
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	3,000	3,920	444,660	2041/02/15		
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	5,000	5,557	630,375	2044/02/15		
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	2,500	2,508	284,547	2022/02/15		
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	750	933	105,928	2038/02/15		
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	3,700	4,740	537,758	2040/02/15		
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	10,500	9,826	1,114,611	2026/02/15		
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	6,000	5,373	609,486	2045/02/15		
US T N/B 2.75 02/15/19	国債証券	2.7500	12,000	12,361	1,402,144	2019/02/15		
US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	3.6250	17,000	18,062	2,048,829	2020/02/15		
US T N/B 3.5 02/15/18	国債証券	3.5000	2,000	2,050	232,583	2018/02/15		
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	7,000	7,237	820,990	2024/02/15		
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	9,500	9,263	1,050,720	2025/02/15		
US T N/B 1.375 02/28/19	国債証券	1.3750	13,000	13,037	1,478,895	2019/02/28		
US T N/B 3.625 02/15/21	国債証券	3.6250	5,500	5,896	668,801	2021/02/15		
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	9,500	9,439	1,070,763	2023/02/15		
US T N/B 0.75 02/28/18	国債証券	0.7500	13,500	13,476	1,528,609	2018/02/28		
US T N/B 2.0 02/28/21	国債証券	2.0000	11,000	11,107	1,259,907	2021/02/28		
US T N/B 2.875 03/31/18	国債証券	2.8750	10,000	10,210	1,158,131	2018/03/31		
US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	1.7500	3,000	2,969	336,832	2022/03/31		
US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	2.2500	11,500	11,713	1,328,694	2021/03/31		
US T N/B 1.625 03/31/19	国債証券	1.6250	15,000	15,112	1,714,210	2019/03/31		
US T N/B 1.375 03/31/20	国債証券	1.3750	6,300	6,272	711,479	2020/03/31		
US T N/B 1.375 04/30/20	国債証券	1.3750	12,000	11,934	1,353,714	2020/04/30		
US T N/B 0.75 04/15/18	国債証券	0.7500	3,000	2,992	339,463	2018/04/15		
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	1,400	1,982	224,871	2030/05/15		
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	2,790	3,455	392,001	2040/05/15		
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	2,450	3,042	345,056	2041/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	2,270	2,262	256,680	2042/05/15		
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	1,630	1,984	225,089	2039/05/15		
US T N/B 3.125 05/15/19	国債証券	3.1250	13,000	13,520	1,533,573	2019/05/15		
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	6,070	5,893	668,504	2043/05/15		
US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	3.5000	14,000	14,853	1,684,841	2020/05/15		

銘柄	柄	当期					末	
		種類	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		
US T N/B 3.375 05/15/44		国債証券	3.3750	6,690	7,119	807,572	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45		国債証券	3.0000	6,500	6,443	730,843	2045/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46		国債証券	2.5000	5,000	4,466	506,578	2046/05/15	
US T N/B 1.125 05/31/19		国債証券	1.1250	11,000	10,956	1,242,801	2019/05/31	
US T N/B 1.75 05/15/22		国債証券	1.7500	15,000	14,824	1,681,509	2022/05/15	
US T N/B 1.375 05/31/20		国債証券	1.3750	3,500	3,478	394,523	2020/05/31	
US T N/B 4.5 05/15/38		国債証券	4.5000	1,430	1,810	205,416	2038/05/15	
US T N/B 3.875 05/15/18		国債証券	3.8750	8,000	8,287	940,080	2018/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/23		国債証券	1.7500	15,000	14,646	1,661,295	2023/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24		国債証券	2.5000	9,000	9,148	1,037,693	2024/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/21		国債証券	3.1250	8,000	8,424	955,570	2021/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25		国債証券	2.1250	10,500	10,309	1,169,421	2025/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37		国債証券	5.0000	1,430	1,920	217,834	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26		国債証券	1.6250	11,500	10,736	1,217,816	2026/05/15	
US T N/B 2.0 05/31/21		国債証券	2.0000	12,000	12,093	1,371,790	2021/05/31	
US T N/B 1.0 05/31/18		国債証券	1.0000	10,000	10,000	1,134,300	2018/05/31	
US T N/B 2.375 06/30/18		国債証券	2.3750	15,000	15,275	1,732,739	2018/06/30	
US T N/B 1.375 06/30/23		国債証券	1.3750	14,000	13,342	1,513,446	2023/06/30	
US T N/B 1.875 06/30/20		国債証券	1.8750	11,000	11,103	1,259,421	2020/06/30	
US T N/B 2.125 06/30/22		国債証券	2.1250	9,500	9,557	1,084,147	2022/06/30	
US T N/B 0.875 07/31/19		国債証券	0.8750	7,000	6,922	785,164	2019/07/31	
US T N/B 0.875 07/15/18		国債証券	0.8750	10,000	9,979	1,131,940	2018/07/15	
US T N/B 6.25 08/15/23		国債証券	6.2500	6,000	7,495	850,187	2023/08/15	
US T N/B 3.75 08/15/41		国債証券	3.7500	2,980	3,369	382,251	2041/08/15	
US T N/B 5.5 08/15/28		国債証券	5.5000	1,800	2,333	264,652	2028/08/15	
US T N/B 3.875 08/15/40		国債証券	3.8750	2,570	2,962	336,038	2040/08/15	
US T N/B 2.75 08/15/42		国債証券	2.7500	3,890	3,695	419,145	2042/08/15	
US T N/B 3.125 08/15/44		国債証券	3.1250	6,100	6,198	703,111	2044/08/15	
US T N/B 8.125 08/15/19		国債証券	8.1250	4,000	4,661	528,742	2019/08/15	
US T N/B 4.5 08/15/39		国債証券	4.5000	1,400	1,762	199,892	2039/08/15	
US T N/B 3.625 08/15/43		国債証券	3.6250	5,200	5,781	655,820	2043/08/15	
US T N/B 4.0 08/15/18		国債証券	4.0000	12,000	12,527	1,421,023	2018/08/15	
US T N/B 2.875 08/15/45		国債証券	2.8750	6,400	6,189	702,068	2045/08/15	
US T N/B 1.5 08/31/18		国債証券	1.5000	12,700	12,782	1,449,895	2018/08/31	
US T N/B 2.0 08/15/25		国債証券	2.0000	12,000	11,641	1,320,529	2025/08/15	
US T N/B 2.125 08/15/21		国債証券	2.1250	21,000	21,229	2,408,065	2021/08/15	
US T N/B 2.5 08/15/23		国債証券	2.5000	8,000	8,151	924,663	2023/08/15	
US T N/B 2.375 08/15/24		国債証券	2.3750	8,900	8,959	1,016,230	2024/08/15	
US T N/B 2.25 08/15/46		国債証券	2.2500	7,500	6,329	717,994	2046/08/15	
US T N/B 3.625 08/15/19		国債証券	3.6250	5,000	5,275	598,360	2019/08/15	
US T N/B 2.625 08/15/20		国債証券	2.6250	16,500	17,049	1,933,881	2020/08/15	
US T N/B 1.5 08/15/26		国債証券	1.5000	12,000	11,050	1,253,424	2026/08/15	
US T N/B 1.625 08/15/22		国債証券	1.6250	15,000	14,696	1,667,012	2022/08/15	
US T N/B 1.0 08/31/19		国債証券	1.0000	13,500	13,377	1,517,354	2019/08/31	
US T N/B 2.125 08/31/20		国債証券	2.1250	3,000	3,049	345,870	2020/08/31	
US T N/B 1.875 08/31/22		国債証券	1.8750	7,000	6,938	786,998	2022/08/31	
US T N/B 1.375 09/30/18		国債証券	1.3750	35,500	35,652	4,044,039	2018/09/30	

銘柄	当	期				末	
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.0 09/30/19	国債証券	1.0000	5,000	4,949	561,365	2019/09/30	
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	10,000	10,106	1,146,346	2021/09/30	
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	5,000	4,746	538,435	2023/09/30	
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	5,000	4,920	558,109	2022/09/30	
US T N/B 2.0 09/30/20	国債証券	2.0000	6,000	6,072	688,815	2020/09/30	
US T N/B 1.75 10/31/20	国債証券	1.7500	6,000	6,016	682,437	2020/10/31	
US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	1.2500	7,000	6,970	790,659	2019/10/31	
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	6,000	7,658	868,665	2021/11/15	
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,500	1,913	217,019	2028/11/15	
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	1,400	1,880	213,277	2027/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	5,800	5,754	652,696	2044/11/15	
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	2,000	2,435	276,236	2040/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	3,400	3,225	365,896	2042/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,800	1,835	208,175	2041/11/15	
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	5,700	6,476	734,591	2043/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	6,000	5,945	674,352	2045/11/15	
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	2,500	2,420	274,599	2046/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	10,500	10,449	1,185,333	2024/11/15	
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,660	2,055	233,203	2039/11/15	
US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	2.6250	6,000	6,202	703,597	2020/11/15	
US T N/B 3.375 11/15/19	国債証券	3.3750	4,000	4,211	477,730	2019/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	10,400	10,446	1,184,921	2021/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	10,000	9,878	1,120,472	2025/11/15	
US T N/B 2.0 11/30/20	国債証券	2.0000	10,500	10,613	1,203,854	2020/11/30	
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	7,500	7,318	830,120	2022/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	10,000	10,339	1,172,843	2023/11/15	
US T N/B 1.0 11/30/19	国債証券	1.0000	6,500	6,425	728,793	2019/11/30	
US T N/B 2.375 12/31/20	国債証券	2.3750	8,300	8,504	964,629	2020/12/31	
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	15,700	15,854	1,798,374	2021/12/31	
US T N/B 1.5 12/31/18	国債証券	1.5000	17,000	17,098	1,939,455	2018/12/31	
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	8,000	8,013	908,991	2022/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/20	国債証券	1.7500	9,000	9,007	1,021,666	2020/12/31	
US T N/B 1.25 12/15/18	国債証券	1.2500	15,000	15,020	1,703,763	2018/12/15	
小計	-	-	950,710	968,150	109,817,254	-	
(カナダ)			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 1.25 03/01/18	国債証券	1.2500	1,600	1,610	139,210	2018/03/01	
CANADA 1.75 03/01/19	国債証券	1.7500	1,900	1,937	167,478	2019/03/01	
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,700	1,669	144,373	2026/06/01	
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	1,000	1,577	136,365	2027/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,800	2,529	218,736	2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	1,800	2,659	229,927	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	1,860	2,644	228,642	2037/06/01	
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	2,500	2,674	231,209	2024/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	2,350	3,021	261,197	2041/06/01	
CANADA 4.25 06/01/18	国債証券	4.2500	5,500	5,748	497,009	2018/06/01	
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.2500	4,700	5,121	442,800	2021/06/01	
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	3,900	4,204	363,478	2022/06/01	

銘柄	当			期		末
	種類	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	
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,800	1,814	156,851	2023/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,800	1,889	163,400	2025/06/01
CANADA 3.5 06/01/20	国債証券	3.5000	4,300	4,650	402,096	2020/06/01
CANADA 3.75 06/01/19	国債証券	3.7500	3,700	3,944	341,037	2019/06/01
CANADA 1.25 09/01/18	国債証券	1.2500	2,450	2,469	213,530	2018/09/01
CANADA 0.75 09/01/20	国債証券	0.7500	2,400	2,379	205,758	2020/09/01
CANADA 0.5 11/01/18	国債証券	0.5000	4,600	4,581	396,125	2018/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	2,300	2,798	241,988	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	1,000	1,076	93,039	2048/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	900	993	85,874	2064/12/01
小計	—	—	55,860	61,995	5,360,132	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	800	686	59,790	2047/03/21
AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	国債証券	5.2500	4,500	4,809	418,739	2019/03/15
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	4,000	4,168	362,925	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	3,900	4,572	398,083	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	3,900	3,944	343,445	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	5,100	5,723	498,263	2026/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	4.5000	4,400	4,733	412,061	2020/04/15
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	3,000	3,523	306,776	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,900	1,950	169,785	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	1,800	2,086	181,682	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	1,650	1,713	149,137	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	1,000	936	81,540	2028/05/21
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.7500	3,700	4,235	368,716	2021/05/15
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	700	662	57,685	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	900	820	71,391	2035/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	4,000	4,696	408,858	2022/07/15
AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	国債証券	3.2500	2,400	2,458	214,079	2018/10/21
AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	国債証券	2.7500	1,500	1,531	133,371	2019/10/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	3,200	3,161	275,234	2027/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	国債証券	1.7500	2,400	2,368	206,179	2020/11/21
小計	—	—	54,750	58,784	5,117,750	—
(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	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	1,000	1,101	87,881	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	310	324	25,923	2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	610	637	50,881	2042/04/01
SINGAPORE 0.5 04/01/18	国債証券	0.5000	880	875	69,876	2018/04/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	400	416	33,268	2029/07/01
SINGAPORE 2.0 07/01/20	国債証券	2.0000	800	814	65,037	2020/07/01
SINGAPORE 4.0 09/01/18	国債証券	4.0000	1,550	1,619	129,238	2018/09/01
SINGAPORE 3.25 09/01/20	国債証券	3.2500	1,340	1,421	113,429	2020/09/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	810	860	68,662	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	1,600	1,711	136,587	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	460	479	38,267	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	480	535	42,719	2033/09/01
小計	—	—	10,240	10,796	861,776	—

銘柄	柄	当期					未	
		種類	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		
UK TREASURY 3.25 01/22/44		国債証券	3.2500	3,300	4,196	593,312	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45		国債証券	3.5000	3,250	4,333	612,720	2045/01/22	
UK TREASURY 4.0 01/22/60		国債証券	4.0000	2,200	3,683	520,866	2060/01/22	
UK TREASURY 1.5 01/22/21		国債証券	1.5000	3,200	3,337	471,885	2021/01/22	
UK TREASURY 5.0 03/07/25		国債証券	5.0000	2,880	3,770	533,151	2025/03/07	
UK TREASURY 5.0 03/07/18		国債証券	5.0000	900	945	133,740	2018/03/07	
UK TREASURY 4.5 03/07/19		国債証券	4.5000	2,400	2,616	370,011	2019/03/07	
UK TREASURY 4.0 03/07/22		国債証券	4.0000	2,300	2,702	382,041	2022/03/07	
UK TREASURY 4.25 03/07/36		国債証券	4.2500	3,350	4,654	658,098	2036/03/07	
UK TREASURY 4.75 03/07/20		国債証券	4.7500	5,400	6,146	869,098	2020/03/07	
UK TREASURY 4.25 06/07/32		国債証券	4.2500	2,450	3,307	467,716	2032/06/07	
UK TREASURY 8.0 06/07/21		国債証券	8.0000	2,000	2,651	374,909	2021/06/07	
UK TREASURY 3.75 07/22/52		国債証券	3.7500	2,600	3,899	551,384	2052/07/22	
UK TREASURY 2.5 07/22/65		国債証券	2.5000	1,700	2,111	298,499	2065/07/22	
UK TREASURY 3.5 07/22/68		国債証券	3.5000	2,480	3,939	556,968	2068/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/22/26		国債証券	1.5000	1,200	1,229	173,824	2026/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/22/18		国債証券	1.2500	3,000	3,049	431,126	2018/07/22	
UK TREASURY 2.0 07/22/20		国債証券	2.0000	1,500	1,586	224,279	2020/07/22	
UK TREASURY 1.75 07/22/19		国債証券	1.7500	4,700	4,881	690,257	2019/07/22	
UK TREASURY 4.25 09/07/39		国債証券	4.2500	1,850	2,642	373,602	2039/09/07	
UK TREASURY 3.75 09/07/21		国債証券	3.7500	3,200	3,677	520,016	2021/09/07	
UK TREASURY 2.25 09/07/23		国債証券	2.2500	3,500	3,830	541,659	2023/09/07	
UK TREASURY 2.75 09/07/24		国債証券	2.7500	2,800	3,170	448,272	2024/09/07	
UK TREASURY 2.0 09/07/25		国債証券	2.0000	2,900	3,115	440,553	2025/09/07	
UK TREASURY 3.75 09/07/20		国債証券	3.7500	2,900	3,256	460,505	2020/09/07	
UK TREASURY 3.75 09/07/19		国債証券	3.7500	2,200	2,402	339,706	2019/09/07	
UK TREASURY 4.5 09/07/34		国債証券	4.5000	3,100	4,377	618,979	2034/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/22		国債証券	1.7500	3,300	3,501	495,095	2022/09/07	
UK TREASURY 6.0 12/07/28		国債証券	6.0000	1,450	2,185	309,060	2028/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/38		国債証券	4.7500	2,400	3,633	513,788	2038/12/07	
UK TREASURY 4.5 12/07/42		国債証券	4.5000	2,800	4,268	603,576	2042/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/46		国債証券	4.2500	2,400	3,661	517,724	2046/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55		国債証券	4.2500	2,990	5,051	714,246	2055/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/27		国債証券	4.2500	2,160	2,796	395,373	2027/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/40		国債証券	4.2500	2,500	3,613	510,912	2040/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/30		国債証券	4.7500	2,200	3,075	434,859	2030/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/49		国債証券	4.2500	2,070	3,281	464,010	2049/12/07	
小計		-	-	97,530	124,590	17,615,840	-	
(デンマーク)			%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円		
DENMARK 4.5 11/15/39		国債証券	4.5000	17,000	28,716	464,059	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25		国債証券	1.7500	13,470	15,145	244,753	2025/11/15	
DENMARK 4.0 11/15/19		国債証券	4.0000	13,900	15,641	252,769	2019/11/15	
DENMARK 3.0 11/15/21		国債証券	3.0000	13,000	15,046	243,157	2021/11/15	
DENMARK 1.5 11/15/23		国債証券	1.5000	5,500	6,070	98,105	2023/11/15	
DENMARK 0.25 11/15/18		国債証券	0.2500	4,000	4,061	65,637	2018/11/15	
小計		-	-	66,870	84,683	1,368,483	-	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ノルウェー)						
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	千ノルウェー・クローネ 2,000	千ノルウェー・クローネ 1,978	千円 26,871	2026/02/19
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	7,400	8,188	111,197	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,800	3,859	52,413	2025/03/13
NORWAY 4.5 05/22/19	国債証券	4.5000	6,560	7,124	96,755	2019/05/22
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	7,600	7,927	107,651	2023/05/24
NORWAY 3.75 05/25/21	国債証券	3.7500	9,100	10,145	137,777	2021/05/25
小 計	—	—	36,460	39,224	532,665	—
(スウェーデン)						
SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	4.2500	千スウェーデン・クローナ 12,300	千スウェーデン・クローナ 13,539	千円 171,406	2019/03/12
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	6,400	8,563	108,418	2039/03/30
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	11,800	13,770	174,329	2025/05/12
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	11,870	14,082	178,289	2022/06/01
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	9,700	10,528	133,288	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	5,000	5,154	65,258	2026/11/12
SWEDEN 5.0 12/01/20	国債証券	5.0000	11,410	13,713	173,612	2020/12/01
小 計	—	—	68,480	79,352	1,004,603	—
(メキシコ)						
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 5,000	千メキシコ・ペソ 4,456	千円 24,777	2026/03/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	31,000	33,173	184,445	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	10,000	9,989	55,541	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	10,000	10,001	55,607	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	10,000	9,701	53,942	2022/06/09
MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	国債証券	6.5000	38,000	37,138	206,488	2021/06/10
MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	8.0000	30,000	30,880	171,695	2020/06/11
MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	国債証券	4.7500	41,500	40,442	224,860	2018/06/14
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	20,000	19,580	108,864	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,000	15,888	88,340	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	16,500	19,971	111,039	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	7,000	6,921	38,484	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	41,000	47,557	264,419	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	14,539	80,837	2023/12/07
MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	国債証券	8.5000	15,000	15,422	85,750	2018/12/13
MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	国債証券	5.0000	21,000	19,958	110,971	2019/12/11
小 計	—	—	325,000	335,623	1,866,066	—
(マレーシア)						
MALAYSIA 4.24 02/07/18	国債証券	4.2400	千マレーシア・リンギット 2,300	千マレーシア・リンギット 2,325	千円 59,167	2018/02/07
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	779	19,834	2027/03/15
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,190	30,276	2023/03/15
MALAYSIA 3.492 03/31/20	国債証券	3.4920	2,200	2,193	55,800	2020/03/31
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,140	79,901	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	1,806	45,955	2030/04/15
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,850	1,749	44,517	2032/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,113	28,320	2033/04/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	2,570	2,394	60,906	2027/05/31
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.1600	5,500	5,596	142,368	2021/07/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	1,430	1,446	36,797	2024/07/15
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	3,000	2,931	74,578	2022/08/15

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,600	1,727	43,937	2028/09/15
MALAYSIA 3.58 09/28/18	国債証券	3.5800	3,700	3,722	94,711	2018/09/28
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,500	1,515	38,557	2043/09/30
MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	4.3780	3,680	3,766	95,819	2019/11/29
小計	—	—	37,430	37,399	951,449	—
(南アフリカ)		%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	国債証券	8.0000	13,110	11,986	104,044	2030/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8.7500	10,000	9,232	80,136	2044/01/31
SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	国債証券	9.0000	3,000	2,852	24,761	2040/01/31
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8.5000	10,910	9,932	86,210	2037/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8.7500	17,000	15,623	135,615	2048/02/28
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6.5000	11,760	8,445	73,306	2041/02/28
SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	国債証券	7.7500	4,000	3,890	33,766	2023/02/28
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	11,600	9,617	83,480	2031/02/28
SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	国債証券	8.8750	3,000	2,862	24,842	2035/02/28
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8.2500	10,000	9,162	79,526	2032/03/31
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6.2500	14,700	10,615	92,140	2036/03/31
SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	国債証券	6.7500	19,660	18,816	163,326	2021/03/31
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10.5000	25,000	27,821	241,490	2026/12/21
SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	国債証券	8.0000	7,000	7,038	61,090	2018/12/21
小計	—	—	160,740	147,896	1,283,738	—
(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	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,840	2,180	60,665	2029/04/25
POLAND 3.75 04/25/18	国債証券	3.7500	5,000	5,125	142,577	2018/04/25
POLAND 1.5 04/25/20	国債証券	1.5000	3,000	2,907	80,872	2020/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	4,200	3,800	105,737	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	5,300	5,158	143,501	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/18	国債証券	2.5000	1,500	1,514	42,134	2018/07/25
POLAND 1.75 07/25/21	国債証券	1.7500	2,200	2,091	58,186	2021/07/25
POLAND 3.25 07/25/19	国債証券	3.2500	3,070	3,136	87,252	2019/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	4,000	4,508	125,434	2022/09/23
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.2500	6,890	7,496	208,547	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.7500	3,680	4,119	114,611	2021/10/25
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	3,100	3,205	89,178	2023/10/25
POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	5.5000	2,690	2,907	80,897	2019/10/25
POLAND 10/25/18	国債証券	—	2,000	1,933	53,792	2018/10/25
小計	—	—	48,470	50,085	1,393,392	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	1,210	1,166	140,066	2045/02/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	1,030	1,227	147,446	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	1,600	2,165	260,109	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	800	970	116,567	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0.8000	800	828	99,466	2022/03/15
IRISH 4.5 04/18/20	国債証券	4.5000	1,450	1,667	200,312	2020/04/18
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	1,100	1,207	145,011	2030/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	1,000	993	119,357	2026/05/15
IRISH 4.4 06/18/19	国債証券	4.4000	1,130	1,255	150,740	2019/06/18

銘柄	当			期		末
	種類	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…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 5.0 10/18/20	国債証券	5.0000	1,400	1,669	200,463	2020/10/18
IRISH 4.5 10/18/18	国債証券	4.5000	740	799	96,075	2018/10/18
IRISH 5.9 10/18/19	国債証券	5.9000	950	1,108	133,091	2019/10/18
小計	—	—	13,210	15,060	1,808,709	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	2,120	3,343	401,525	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,650	2,281	273,992	2047/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	2,200	2,713	325,888	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	2,000	3,037	364,815	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	2,150	3,320	398,761	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,740	2,159	259,397	2033/01/15
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	国債証券	1.2500	2,060	2,137	256,772	2019/01/15
NETHERLANDS 01/15/22	国債証券	—	1,300	1,319	158,431	2022/01/15
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	国債証券	0.2500	2,150	2,206	265,026	2020/01/15
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	国債証券	3.5000	2,270	2,588	310,876	2020/07/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	国債証券	3.2500	2,180	2,539	304,965	2021/07/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	2,400	2,685	322,580	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,700	1,704	204,680	2026/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	国債証券	4.0000	2,660	2,836	340,710	2018/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	1,550	1,763	211,853	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	2,000	2,276	273,374	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	2,500	2,486	298,673	2025/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	国債証券	4.0000	3,070	3,418	410,555	2019/07/15
小計	—	—	37,700	44,820	5,382,883	—
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/22	国債証券	4.0000	2,300	2,802	336,566	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	3,050	4,567	548,585	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	2,400	3,669	440,672	2041/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/19	国債証券	4.0000	1,950	2,138	256,787	2019/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,600	2,158	259,250	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	1,200	1,663	199,745	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	2,700	4,306	517,152	2035/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/18	国債証券	4.0000	500	525	63,131	2018/03/28
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	1,400	2,018	242,383	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	900	845	101,497	2047/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	400	396	47,670	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,400	1,441	173,121	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	2,600	3,037	364,822	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,300	1,262	151,620	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	2,000	2,285	274,447	2023/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	850	1,070	128,599	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	700	744	89,394	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	2,700	2,763	331,896	2025/06/22
BELGIUM 1.25 06/22/18	国債証券	1.2500	1,600	1,640	197,004	2018/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.2500	2,150	2,606	313,098	2021/09/28
BELGIUM 3.75 09/28/20	国債証券	3.7500	3,000	3,457	415,195	2020/09/28

銘柄	当	期				末		
		種類	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…ベルギー)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	2,300	2,867	344,395		2022/09/28	
BELGIUM 3.0 09/28/19	国債証券	3.0000	2,100	2,293	275,466		2019/09/28	
小計	—	—	41,100	50,562	6,072,509		—	
(ユーロ…フランス)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	国債証券	3.7500	7,200	8,367	1,004,908		2021/04/25	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	2,200	3,299	396,216		2023/04/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	6,940	8,513	1,022,447		2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	4,300	6,442	773,746		2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	2,400	3,533	424,318		2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,840	2,757	331,206		2060/04/25	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	国債証券	4.2500	6,200	6,832	820,571		2019/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	4,100	6,069	728,919		2029/04/25	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	5,300	6,096	732,143		2022/04/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	国債証券	3.5000	8,300	9,297	1,116,648		2020/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	4,100	6,113	734,207		2035/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	国債証券	4.0000	3,900	4,108	493,458		2018/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	3,550	4,450	534,453		2045/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	150	127	15,273		2066/05/25	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	3,200	3,599	432,275		2024/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	4,300	4,882	586,401		2030/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,700	3,718	446,636		2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	4,300	4,220	506,922		2025/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	2,200	2,110	253,476		2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	国債証券	1.0000	1,700	1,753	210,627		2019/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	4,400	4,787	574,963		2023/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	1,800	1,648	197,999		2036/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	国債証券	1.0000	2,500	2,548	306,074		2018/05/25	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	6,600	8,280	994,534		2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	3,590	5,175	621,541		2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	5,940	6,891	827,693		2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	4,010	5,596	672,156		2038/10/25	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3.2500	7,800	8,992	1,079,957		2021/10/25	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	国債証券	8.5000	4,200	5,200	624,577		2019/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	4,600	7,341	881,665		2032/10/25	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	国債証券	4.2500	6,900	7,454	895,266		2018/10/25	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	4,700	5,240	629,400		2022/10/25	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	国債証券	3.7500	6,600	7,331	880,502		2019/10/25	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	国債証券	2.5000	9,700	10,671	1,281,699		2020/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	6,460	7,026	843,926		2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	4,700	4,760	571,734		2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	1,500	1,389	166,889		2026/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	国債証券	1.0000	1,200	1,231	147,903		2018/11/25	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	国債証券	0.5000	500	511	61,422		2019/11/25	
小計	—	—	167,580	198,374	23,824,769		—	
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	1,400	2,028	243,581		2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	2,360	3,702	444,682		2028/01/04	

銘柄	当			期		末
	種類	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…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	1,500	2,584	310,389	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	2,200	3,659	439,485	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	3,100	4,899	588,454	2037/01/04
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2.0000	3,300	3,712	445,926	2022/01/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	国債証券	3.7500	4,900	5,328	639,894	2019/01/04
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債証券	3.2500	7,700	8,611	1,034,198	2020/01/04
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	国債証券	2.5000	2,700	3,037	364,745	2021/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	3,900	4,072	489,050	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	4,200	4,343	521,701	2026/02/15
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	1,000	1,112	133,648	2023/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,500	1,706	204,989	2024/02/15
BUNDESUBL 0.5 02/23/18	国債証券	0.5000	2,500	2,535	304,486	2018/02/23
BUNDESUBL 0.5 04/12/19	国債証券	0.5000	3,100	3,191	383,300	2019/04/12
BUNDESUBL 04/09/21	国債証券	-	3,200	3,285	394,612	2021/04/09
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	3,800	4,259	511,606	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	3,800	4,238	509,005	2023/05/15
BUNDESSCHAT 06/15/18	国債証券	-	2,300	2,326	279,409	2018/06/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,750	2,866	344,314	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,600	2,381	286,030	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	2,200	3,683	442,346	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	2,050	3,069	368,674	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,800	3,747	450,093	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	2,200	3,957	475,326	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.2500	3,800	4,453	534,831	2021/07/04
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3.0000	4,500	5,077	609,800	2020/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	3,500	3,920	470,800	2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	国債証券	4.2500	5,200	5,567	668,711	2018/07/04
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	国債証券	3.5000	5,900	6,515	782,460	2019/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	3,100	5,151	618,678	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,780	3,758	451,449	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	3,200	3,463	415,972	2025/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	-	2,600	2,545	305,708	2026/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	3,100	3,567	428,443	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	2,600	2,820	338,724	2024/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	3,500	3,957	475,335	2021/09/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2.2500	4,200	4,648	558,302	2020/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	2,200	2,439	293,009	2022/09/04
BUNDESUBL 1.0 10/12/18	国債証券	1.0000	1,800	1,855	222,857	2018/10/12
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	国債証券	0.2500	1,000	1,035	124,357	2020/10/16
小計	-	-	124,040	149,120	17,909,398	-
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	3,700	4,670	560,937	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	3,000	4,314	518,230	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	2,200	2,755	330,961	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	2,600	3,269	392,648	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	3,200	4,067	488,559	2023/01/31
SPAIN 4.5 01/31/18	国債証券	4.5000	2,500	2,612	313,773	2018/01/31

銘柄	当			期		末
	種類	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…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 1.4 01/31/20	国債証券	1.4000	400	416	50,005	2020/01/31
SPAIN 0.25 01/31/19	国債証券	0.2500	1,400	1,411	169,466	2019/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	2,500	2,546	305,789	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	3,400	4,025	483,445	2024/04/30
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.5000	4,200	5,122	615,190	2021/04/30
SPAIN 4.0 04/30/20	国債証券	4.0000	4,000	4,502	540,704	2020/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	3,200	3,310	397,567	2026/04/30
SPAIN 2.75 04/30/19	国債証券	2.7500	2,000	2,126	255,431	2019/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	2,800	3,856	463,165	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	2,200	3,036	364,623	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	2,100	2,840	341,174	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	500	515	61,961	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	3,600	4,524	543,368	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	2,700	2,653	318,705	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	3,000	4,387	526,913	2032/07/30
SPAIN 4.1 07/30/18	国債証券	4.1000	4,300	4,569	548,743	2018/07/30
SPAIN 4.6 07/30/19	国債証券	4.6000	4,700	5,236	628,881	2019/07/30
SPAIN 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	1,700	1,735	208,382	2021/07/30
SPAIN 1.15 07/30/20	国債証券	1.1500	2,100	2,176	261,403	2020/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	3,400	3,770	452,840	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	2,200	2,936	352,628	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,800	2,584	310,369	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,300	1,296	155,692	2046/10/31
SPAIN 4.85 10/31/20	国債証券	4.8500	2,900	3,401	408,502	2020/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	2,600	2,743	329,437	2025/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,800	1,752	210,526	2026/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	2,900	3,547	426,111	2023/10/31
SPAIN 4.3 10/31/19	国債証券	4.3000	5,600	6,254	751,115	2019/10/31
SPAIN 3.75 10/31/18	国債証券	3.7500	2,700	2,884	346,450	2018/10/31
小計	-	-	95,200	111,854	13,433,709	-
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	国債証券	4.2500	3,900	4,215	506,245	2019/02/01
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	国債証券	4.5000	4,500	5,043	605,682	2020/02/01
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	3,270	4,532	544,319	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	4,350	5,025	603,516	2037/02/01
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	国債証券	4.5000	4,400	4,596	551,992	2018/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,350	1,206	144,916	2047/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	3,700	4,377	525,734	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	1,100	912	109,572	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	4,430	5,430	652,231	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	国債証券	4.5000	7,900	8,596	1,032,473	2019/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	6,200	7,387	887,214	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	3,600	4,288	515,070	2026/03/01
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	国債証券	4.2500	5,200	5,801	696,776	2020/03/01
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国債証券	3.7500	3,300	3,709	445,550	2021/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	3,100	2,779	333,798	2032/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	3,100	3,424	411,272	2030/03/01

銘柄	当	期				末		
		種類	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…イタリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	2,500	2,442	293,284	2023/03/15		
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	1,500	1,518	182,347	2022/04/15		
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	4,200	5,876	705,784	2031/05/01		
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,650	198,248	2023/05/01		
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	国債証券	3.7500	2,300	2,586	310,675	2021/05/01		
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,500	1,434	172,331	2026/06/01		
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	2,500	2,418	290,410	2025/06/01		
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	4,500	5,080	610,114	2021/08/01		
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	3,500	4,531	544,185	2034/08/01		
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	3,000	3,888	467,056	2039/08/01		
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	5,100	6,124	735,563	2023/08/01		
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	国債証券	4.5000	6,200	6,607	793,578	2018/08/01		
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	2,400	3,013	361,957	2044/09/01		
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	2,300	2,297	275,926	2046/09/01		
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	3,230	3,957	475,256	2028/09/01		
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	2,950	3,800	456,473	2040/09/01		
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.7500	3,900	4,572	549,187	2021/09/01		
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国債証券	4.0000	4,400	4,938	593,121	2020/09/01		
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,900	2,153	258,591	2024/09/01		
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	国債証券	4.2500	6,400	7,034	844,889	2019/09/01		
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	5,000	6,139	737,329	2022/09/01		
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,000	921	110,648	2036/09/01		
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	2,400	3,528	423,712	2023/11/01		
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	2,200	3,163	379,895	2026/11/01		
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	4,000	5,556	667,323	2027/11/01		
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	4,000	5,163	620,100	2029/11/01		
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	2,500	3,074	369,220	2022/11/01		
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	国債証券	0.6500	3,600	3,622	435,083	2020/11/01		
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	2,700	2,683	322,304	2025/12/01		
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	500	460	55,294	2026/12/01		
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	4,000	4,178	501,845	2024/12/01		
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国債証券	2.1500	1,000	1,056	126,849	2021/12/15		
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	国債証券	3.5000	2,100	2,229	267,715	2018/12/01		
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	国債証券	1.0500	2,000	2,041	245,148	2019/12/01		
小計	—	—	166,080	191,072	22,947,823	—		
(ユーロ…フィンランド)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	800	907	108,959	2024/04/15		
FINLAND 3.5 04/15/21	国債証券	3.5000	800	930	111,761	2021/04/15		
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	450	440	52,885	2031/04/15		
FINLAND 3.375 04/15/20	国債証券	3.3750	1,130	1,270	152,545	2020/04/15		
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	700	701	84,250	2026/04/15		
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	1,270	1,390	167,047	2023/04/15		
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	1,010	1,324	159,028	2025/07/04		
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	780	959	115,209	2028/07/04		
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	660	863	103,648	2042/07/04		
FINLAND 4.375 07/04/19	国債証券	4.3750	810	906	108,923	2019/07/04		
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	300	312	37,561	2025/09/15		

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…フィンランド)						
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	400	千ユーロ 439	千円 52,819	2022/09/15
FINLAND 1.125 09/15/18	国債証券	1.1250	400	411	49,424	2018/09/15
FINLAND 0.375 09/15/20	国債証券	0.3750	500	515	61,867	2020/09/15
小 計	—	—	10,010	11,373	1,365,933	—
(ユーロ…オーストリア)						
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	570	千ユーロ 949	千円 114,063	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	50	49	5,931	2047/02/20
AUSTRIA 4.35 03/15/19	国債証券	4.3500	2,300	2,539	305,043	2019/03/15
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	1,500	2,090	251,031	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	1,800	2,717	326,323	2037/03/15
AUSTRIA 3.65 04/20/22	国債証券	3.6500	1,200	1,440	172,944	2022/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	900	1,079	129,632	2034/05/23
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	1,070	1,479	177,725	2044/06/20
AUSTRIA 1.95 06/18/19	国債証券	1.9500	1,400	1,486	178,495	2019/06/18
AUSTRIA 3.9 07/15/20	国債証券	3.9000	2,250	2,590	311,164	2020/07/15
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	1,150	1,808	217,155	2027/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	2,100	2,471	296,851	2021/09/15
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	1,250	1,384	166,336	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	800	811	97,476	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	1,700	1,814	217,953	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	1,400	1,561	187,560	2023/10/20
AUSTRIA 0.25 10/18/19	国債証券	0.2500	200	204	24,600	2019/10/18
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	1,500	1,805	216,889	2022/11/22
小 計	—	—	23,140	28,286	3,397,178	—
合 計	—	—	—	—	243,316,068	—

■投資信託財産の構成

2017年2月21日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 243,316,068	% 97.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,558,853	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	248,874,922	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、248,484,434千円、99.8%です。

(注3) 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、2017年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.43円、1カナダ・ドル=86.46円、1オーストラリア・ドル=87.06円、1シンガポール・ドル=79.82円、1イギリス・ポンド=141.39円、1スイス・フラン=112.87円、1デンマーク・クローネ=16.16円、1ノルウェー・クローネ=13.58円、1スウェーデン・クローナ=12.66円、1メキシコ・ペソ=5.56円、1マレーシア・リンギット=25.44円、1南アフリカ・ランド=8.68円、1ポーランド・ズロチ=27.82円、1ユーロ=120.10円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	249,092,253,171円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	3,444,417,697
公 社 債(評価額)	243,316,068,384
未 収 入 金	217,331,122
未 収 利 息	2,084,939,735
前 払 費 用	29,496,233
(B) 負 債	607,237,560
未 払 金	218,224,560
未 払 解 約 金	389,013,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	248,485,015,611
元 本	143,106,772,360
次 期 繰 越 損 益 金	105,378,243,251
(D) 受 益 権 総 口 数	143,106,772,360口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	17,364円

(注1) 期首元本額 149,758,825,425円
 追加設定元本額 29,937,499,703円
 一部解約元本額 36,589,552,768円

(注2) 期末における元本の内訳

D I AM外国債券パッシブ・ファンド	5,131,485,204円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	13,691,042円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	44,704,339円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	62,814,032円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	39,527,953円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,616,554円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	39,345,731円
たわらノーロード 先進国債券	514,148,531円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	4,782,898,201円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型	447,249,853円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	1,429,659,466円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型	1,468,558,554円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	361,249,152円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	744,657,416円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	554,989,497円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	25,651,436円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	563,298,507円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	6,021,349円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	13,825,526円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	23,935,984円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	45,250,549円
クルーズコントロール	1,781,261,902円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	44,703,644円
D I AM DC バランス・F (成長型)	64,334,306円
クルーズコントロール<DC年金>	656,988円
D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	8,685,786円
D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	28,434,647円
ダイナミック・ナビゲーション	336,463円
D I AMパッシブ資産分散ファンド	1,570,963,668円
D I AM海替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	7,167,138,221円

D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	4,302,370,034円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	3,975,487,139円
D I AMアクティブアロケーション私募ファンド (適格機関投資家限定)	411,883,612円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	571,281円
D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	114,026,758円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,328,163,674円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	815,717,319円
D I AM国際分散/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	83,668,895円
D I AM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	153,380,443円
D I AM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	38,607,745円
D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	12,978,498円
D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,773,797,583円
D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	525,241,479円
D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,483,992,277円
D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,756,191,387円
D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,587,547,137円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA	895,832,183円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	2,044,660,354円
D I AMアクサグローバル/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	4,199,114,002円
D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	15,062,291,264円
D I AMグローバル8私募ファンド (適格機関投資家向け)	19,119,506円
D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	2,036,987,121円
D I AM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	16,133,768,314円
D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	20,496,046,357円
D I AM/バランス30VA (適格機関投資家限定)	26,501,981円
D I AM/バランス50VA (適格機関投資家限定)	252,915円
D I AM/バランス70VA (適格機関投資家限定)	6,037,223円
D I AM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	18,350,730,818円
D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	120,985,005円
D I AM/バランス20VA (適格機関投資家限定)	141,168,530円
D I AM/バランス40VA (適格機関投資家限定)	237,910円
D I AM/バランス60VA (適格機関投資家限定)	154,240円
期末元本合計	143,106,772,360円

■損益の状況

当期 自2016年2月23日 至2017年2月21日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		7,001,601,202円
受 取 利 息		7,002,014,913
支 払 利 息		△413,711
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		△14,409,651,926
売 買 益		3,483,555,273
売 買 損		△17,893,207,199
(C) そ の 他 費 用		△35,574,662
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		△7,443,625,386
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		118,021,806,572
(F) 解 約 差 損 益 金		△26,663,312,232
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		21,463,374,297
(H) 合 計(D + E + F + G)		105,378,243,251
次 期 繰 越 損 益 金(H)		105,378,243,251

(注1) (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2) (F)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3) (G)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。

《お知らせ》

■D I AMアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、ファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。

■委託会社の統合により、約款に所要の変更を行いました。

(平成28年10月1日)