

運用報告書 (全体版)

第1期<決算日2017年10月12日>

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>

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	2016年10月3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、為替ヘッジあり）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 <為替ヘッジあり>	為替フルヘッジ外国債券 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。
	為替フルヘッジ外国債券 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フルヘッジを行います。	
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却益（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<為替ヘッジあり>」は、2017年10月12日に第1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<為替ヘッジあり>

■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、 為替ヘッジあり) (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	騰落率	騰落率			
(設定日) 2016年10月3日	円 10,000	円 -	% -	ポイント (9月30日) 398.82	% -	% -	% -	百万円 1
1期(2017年10月12日)	9,619	0	△3.8	383.88	△3.7	97.7	-	1,294

(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、為替ヘッジあり)です(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、 為替ヘッジあり) (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		
(設定日) 2016年10月3日	円 10,000	% -	ポイント (9月30日) 398.82	% -	% -	% -
10月 末	9,811	△1.9	390.37	△2.1	99.0	-
11月 末	9,623	△3.8	382.83	△4.0	102.7	-
12月 末	9,621	△3.8	383.04	△4.0	98.6	-
2017年 1月 末	9,504	△5.0	378.53	△5.1	95.7	-
2月 末	9,598	△4.0	382.40	△4.1	96.8	-
3月 末	9,574	△4.3	381.61	△4.3	97.6	-
4月 末	9,623	△3.8	383.65	△3.8	102.8	-
5月 末	9,671	△3.3	385.66	△3.3	98.5	-
6月 末	9,634	△3.7	384.17	△3.7	98.9	-
7月 末	9,622	△3.8	383.87	△3.7	96.8	-
8月 末	9,708	△2.9	387.34	△2.9	97.5	-
9月 末	9,621	△3.8	383.97	△3.7	100.1	-
(期末) 2017年10月12日	9,619	△3.8	383.88	△3.7	97.7	-

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

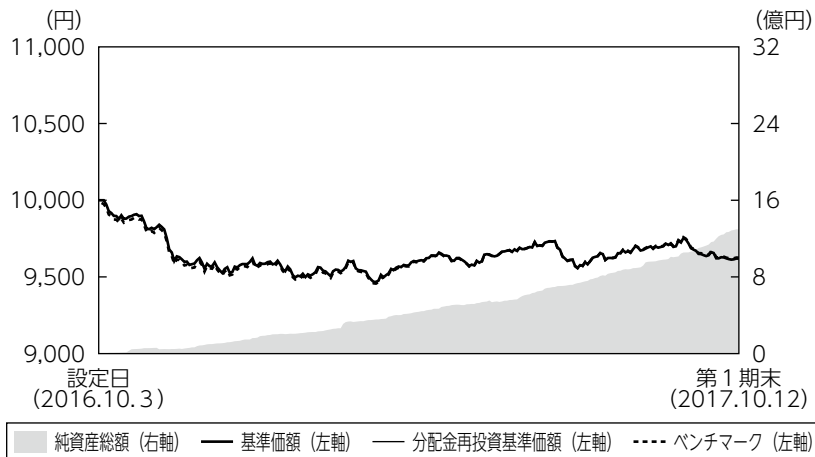
(注2) 騰落率は設定日比です。

(注3) 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4) 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3日から2017年10月12日まで）

基準価額等の推移



設定日： 10,000円
第1期末： 9,619円
(既払分配金0円)
騰落率： $\Delta 3.8\%$
(分配金再投資ベース)

(注) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

- (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) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、設定日前日を10,000とし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）要因となり、基準価額は下落しました。

投資環境

外国債券市場では債券利回りは上昇しました。設定当初から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。

ポートフォリオについて

●当ファンド

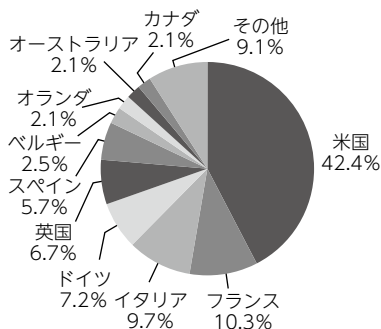
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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、為替ヘッジあり）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。また、組入外貨建資産に対して対円での為替フルヘッジを行いました。

【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】 2017年10月12日現在

○国別配分



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

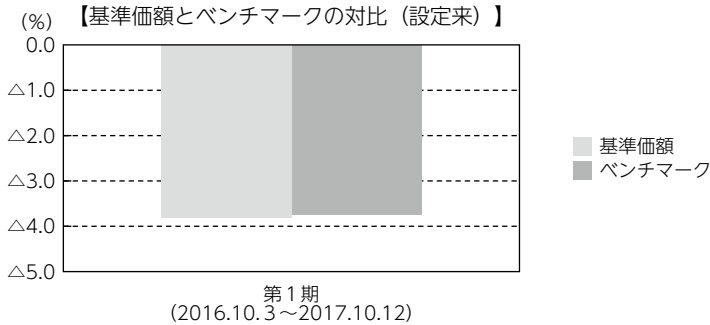
(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(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

ベンチマークは設定来で3.7%下落し、当ファンドはベンチマークを0.1%下回りました。なお、ファンドとベンチマークで採用されている債券時価および為替レートの基準が異なることや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3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	96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、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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。また、組入外貨建資産に対して対円での為替フルヘッジを行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第 1 期		項目の概要
	(2016年10月3日 ～2017年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	21円	0.222%	(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9,641円です。 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
(投信会社)	(9)	(0.097)	
(販売会社)	(9)	(0.097)	
(受託銀行)	(3)	(0.028)	
(b) その他費用	1	0.014	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用
(保管費用)	(1)	(0.010)	
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	23	0.236	

(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3日から2017年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	千口 1,021,164	千円 1,363,172	千口 51,881	千円 69,450

■利害関係人との取引状況等（2016年10月3日から2017年10月12日まで）

【たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
為 替 予 約 取 引	百万円 2,321,659	百万円 292,962	% 12.6	百万円 2,316,102	百万円 293,315	% 12.7

平均保有割合 0.3%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ銀行です。

■自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高 (元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高 (元本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 -	百万円 1	百万円 -	当初設定時又は当初運用時における取得とその処分

■組入資産の明細

親投資信託残高

	当 期		末
	□ 数	評 価	額
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 969,282	千円	1,292,538

■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
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,292,538	99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,479	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	1,302,017	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、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは221,715,739千円、98.5%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	1,302,017,296円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,079,095
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド(評価額)	1,292,538,201
未 収 入 金	1,400,000
(B) 負 債	7,095,122
未 払 解 約 金	6,204,918
未 払 信 託 報 酬	872,841
そ の 他 未 払 費 用	17,363
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,294,922,174
元 本	1,346,233,394
次 期 繰 越 損 益 金	△51,311,220
(D) 受 益 権 総 口 数	1,346,233,394口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,619円

(注) 設定当初の投資元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は1,694,396,065円、同解約元本額は349,162,671円です。

■損益の状況

当期 自2016年10月3日 至2017年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,946円
受 取 利 息	420
支 払 利 息	△2,366
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,216,346
売 買 益	1,160,932
売 買 損	△2,377,278
(C) 信 託 報 酬 等	△1,080,317
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△2,298,609
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△49,012,611
(配 当 等 相 当 額)	(△8,526)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△49,004,085)
(F) 合 計(D+E)	△51,311,220
次 期 繰 越 損 益 金(F)	△51,311,220
追 加 信 託 差 損 益 金	△49,012,611
(配 当 等 相 当 額)	(1,942,740)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△50,955,351)
分 配 準 備 積 立 金	11,056,844
繰 越 損 益 金	△13,355,453

(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) (E)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	11,056,844円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	1,942,740
(d) 分 配 準 備 積 立 金	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	12,999,584
(f) 1万口当たり当期分配対象額	96.56
(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「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第10期 (決算日 2017年6月22日)

(計算期間 2016年6月23日～2017年6月22日)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第10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	2008年1月16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、為替ヘッジあり)」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します。 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割合には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		シティ世界国債インデックス		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	期中騰落率	期中騰落率	(除く日本、円ベース、為替ヘッジあり) (ベンチマーク)	期中騰落率			
6期 (2013年6月24日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
7期 (2014年6月23日)	11,883	1.3	340.73	1.3	95.2	-	173,299
8期 (2015年6月22日)	12,420	4.5	356.26	4.6	98.2	-	173,324
9期 (2016年6月22日)	12,930	4.1	371.27	4.2	98.1	-	179,224
10期 (2017年6月22日)	13,626	5.4	391.61	5.5	92.9	-	164,686
	13,477	△1.1	387.96	△0.9	97.9	-	177,029

(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、為替ヘッジあり) です (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)。

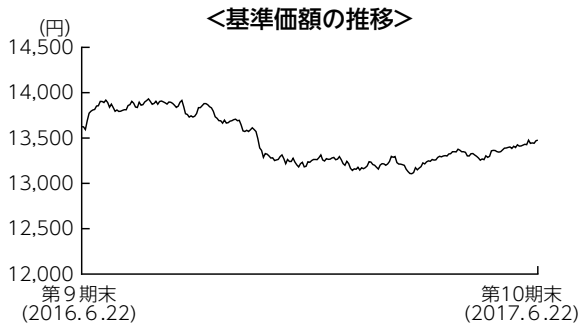
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		シ テ イ 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率	(除く日本、 円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2016 年 6 月 22 日	円 13,626	% -	ポイント 391.61	% -	% 92.9	% -
6 月 末	13,809	1.3	396.92	1.4	90.1	-
7 月 末	13,868	1.8	398.69	1.8	98.8	-
8 月 末	13,895	2.0	399.55	2.0	98.6	-
9 月 末	13,867	1.8	398.82	1.8	96.5	-
10 月 末	13,572	△0.4	390.37	△0.3	99.2	-
11 月 末	13,314	△2.3	382.83	△2.2	102.8	-
12 月 末	13,314	△2.3	383.04	△2.2	98.9	-
2017 年 1 月 末	13,155	△3.5	378.53	△3.3	95.9	-
2 月 末	13,288	△2.5	382.40	△2.4	97.0	-
3 月 末	13,257	△2.7	381.61	△2.6	97.8	-
4 月 末	13,327	△2.2	383.65	△2.0	103.0	-
5 月 末	13,397	△1.7	385.66	△1.5	98.6	-
(期 末) 2017 年 6 月 22 日	13,477	△1.1	387.96	△0.9	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6月23日から2017年6月22日まで）



基準価額の推移

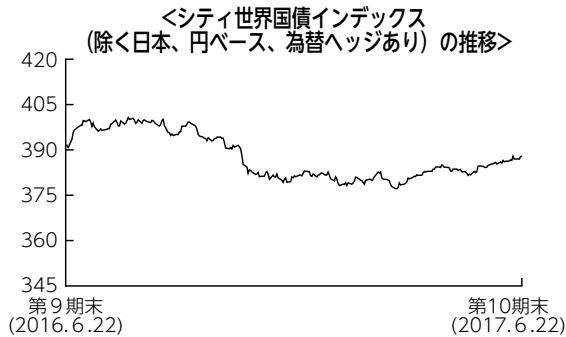
基準価額は13,477円となり、前期末比で1.1%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米国の利上げ期待の高まりや、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債券価格が下落したことから、基準価額は下落しました。

投資環境

外国債券市場では債券利回りは上昇しました。2016年6月から11月にかけては英国のEU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緩やかに上昇しました。米大統領選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や、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、期末にかけて米国、欧州ともに利回りが上昇しました。



ポートフォリオについて

ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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。

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0.9%下落しました。当ファンドはベンチマークを0.2%下回りました。差異の要因としては債券時価および為替の採用基準が異なることが挙げられます。

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 (保管費用)	2円	0.012%
(その他)	(0)	(0.000)
合 計	2	0.012

(注) 金額欄は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(13,476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6月23日から2017年6月22日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 443,798	千アメリカ・ドル 364,422 (-)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 23,928	千カナダ・ドル 19,822 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 24,915	千オーストラリア・ドル 17,635 (-)
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 1,665	千シンガポール・ドル 1,236 (-)
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 49,105	千イギリス・ポンド 46,401 (-)
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 4,253	千デンマーク・クローネ 10,163 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 3,897	千ノルウェー・クローネ 832 (-)
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 8,320	千スウェーデン・クローナ 6,317 (-)
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 82,474	千メキシコ・ペソ 53,195 (-)
	マレーシア	国 債 証 券	千マレーシア・リングgit 3,127	千マレーシア・リングgit 3,102 (-)
南アフリカ	国 債 証 券	千南アフリカ・ランド 15,363	千南アフリカ・ランド 10,050 (-)	

			買付額	売付額	
外 国	国 債 証 券	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 11,424	千ポーランド・ズロチ 8,189 (-)	
		ユ ー ロ 債 証 券	アイルランド	千ユーロ 5,955	千ユーロ 4,797 (-)
			オランダ	17,880	17,145 (-)
			ベルギー	18,687	16,249 (-)
			フランス	82,276	69,974 (-)
			ドイツ	61,104	54,559 (-)
			スペイン	47,803	39,204 (-)
			イタリア	77,964	65,581 (-)
			フィンランド	3,882	2,729 (-)
			オーストリア	11,202	9,814 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2016年6月23日から2017年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
為 替 予 約 取 引	百万円 2,019,410	百万円 215,160	% 10.7	百万円 2,018,833	百万円 215,615	% 10.7

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、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ銀行です。

■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 675,090	千アメリカ・ドル 690,990	千円 76,796,664	% 43.4	% -	% 18.3	% 17.7	% 7.4	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 38,720	千カナダ・ドル 42,601	千円 3,555,135	2.0	-	0.9	0.7	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 40,510	千オーストラリア・ドル 43,850	千円 3,683,432	2.1	-	1.4	0.6	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,500	千シンガポール・ドル 7,997	千円 640,330	0.4	-	0.2	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 69,450	千イギリス・ポンド 88,228	千円 12,428,758	7.0	-	5.2	1.6	0.3	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 47,310	千デンマーク・クローネ 60,033	千円 1,000,762	0.6	-	0.3	0.2	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 30,460	千ノルウェー・クローネ 32,554	千円 423,857	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 54,110	千スウェーデン・クローナ 62,260	千円 790,082	0.4	-	0.2	0.2	0.1	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 247,550	千メキシコ・ペソ 260,434	千円 1,588,651	0.9	-	0.5	0.3	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リングギット 25,370	千マレーシア・リングギット 25,703	千円 666,739	0.4	-	0.2	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 111,550	千南アフリカ・ランド 102,893	千円 874,593	0.5	-	0.4	0.1	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 35,620	千ポーランド・ズロチ 37,050	千円 1,080,384	0.6	-	0.3	0.3	0.0	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	9,690	11,105	1,377,318	0.8	-	0.4	0.3	0.1	
オランダ	26,360	31,138	3,861,785	2.2	-	1.4	0.6	0.2	
ベルギー	28,950	35,695	4,426,952	2.5	-	1.8	0.5	0.1	
フランス	117,750	139,297	17,275,682	9.8	-	6.1	2.8	0.9	
ドイツ	86,570	101,788	12,623,791	7.1	-	4.2	2.0	1.0	
スペイン	67,600	79,023	9,800,466	5.5	-	3.4	1.5	0.6	
イタリア	119,990	135,898	16,854,112	9.5	-	5.6	2.8	1.0	
フィンランド	7,630	8,460	1,049,314	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
オーストリア	17,350	20,728	2,570,800	1.5	-	0.9	0.4	0.2	
合 計	-	-	千円 173,369,615	97.9	-	52.3	32.9	12.7	

(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	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 1.25 01/31/19	国債証券	1.2500	4,700	4,694	521,705	2019/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	13,400	13,643	1,516,380	2024/01/31
US T N/B 1.375 01/31/21	国債証券	1.3750	12,000	11,896	1,322,210	2021/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	800	1,048	116,564	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,260	1,363	151,523	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	2,800	3,023	335,987	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	3,650	3,482	386,992	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	1,200	1,384	153,904	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	830	1,087	120,914	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,400	1,913	212,704	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	1,750	2,301	255,836	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,530	2,103	233,737	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	4,170	4,911	545,860	2044/02/15
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	7,000	7,084	787,393	2022/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	610	793	88,155	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	2,120	2,851	316,939	2040/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	7,700	7,403	822,813	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	4,500	4,301	478,014	2045/02/15
US T N/B 2.75 02/15/19	国債証券	2.7500	3,700	3,785	420,725	2019/02/15
US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	3.6250	8,000	8,449	939,097	2020/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	5,000	5,281	586,997	2047/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	4,630	4,859	540,101	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	6,600	6,578	731,110	2025/02/15
US T N/B 1.75 02/28/22	国債証券	1.7500	7,500	7,501	833,675	2022/02/28
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	6,000	6,045	671,841	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	4,400	4,432	492,605	2027/02/15
US T N/B 1.5 02/28/19	国債証券	1.5000	8,500	8,523	947,344	2019/02/28
US T N/B 1.5 03/31/19	国債証券	1.5000	5,900	5,916	657,594	2019/03/31
US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	2.2500	5,920	6,051	672,542	2021/03/31
US T N/B 1.125 03/31/20	国債証券	1.1250	8,000	7,925	880,886	2020/03/31
US T N/B 1.875 03/31/22	国債証券	1.8750	8,200	8,240	915,831	2022/03/31
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	9,800	9,653	1,072,834	2023/04/30
US T N/B 0.875 04/15/19	国債証券	0.8750	3,300	3,272	363,706	2019/04/15
US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	1.3750	10,000	9,896	1,099,930	2021/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	900	1,303	144,872	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	2,060	2,682	298,079	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,600	2,092	232,574	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	2,710	2,867	318,742	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	1,090	1,393	154,872	2039/05/15
US T N/B 3.125 05/15/19	国債証券	3.1250	4,500	4,648	516,654	2019/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,800	2,889	321,109	2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	4,800	5,424	602,860	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	3,550	3,747	416,460	2045/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	3,550	3,384	376,141	2046/05/15
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	7,270	7,266	807,543	2022/05/15
US T N/B 1.375 05/31/20	国債証券	1.3750	3,160	3,147	349,857	2020/05/31
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	700	925	102,875	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	6,000	5,951	661,471	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	5,990	6,194	688,403	2024/05/15
US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	3.1250	100	105	11,730	2021/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	5,900	5,926	658,696	2025/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	690	965	107,312	2037/05/15

銘柄	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 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	6,000	5,755	639,692	2026/05/15
US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	2.0000	8,060	8,165	907,469	2021/05/31
US T N/B 0.875 05/15/19	国債証券	0.8750	6,200	6,145	682,955	2019/05/15
US T N/B 0.875 05/31/18	国債証券	0.8750	4,000	3,986	443,079	2018/05/31
US T N/B 2.375 06/30/18	国債証券	2.3750	11,300	11,428	1,270,148	2018/06/30
US T N/B 1.125 06/30/21	国債証券	1.1250	10,000	9,785	1,087,604	2021/06/30
US T N/B 0.875 06/15/19	国債証券	0.8750	5,000	4,952	550,376	2019/06/15
US T N/B 2.25 07/31/18	国債証券	2.2500	6,100	6,165	685,208	2018/07/31
US T N/B 2.0 07/31/20	国債証券	2.0000	10,500	10,646	1,183,284	2020/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	8,400	8,079	897,904	2023/07/31
US T N/B 0.75 07/15/19	国債証券	0.7500	11,000	10,860	1,207,013	2019/07/15
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,200	1,505	167,292	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	1,340	1,602	178,078	2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	630	835	92,856	2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,650	2,005	222,892	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	3,220	3,257	362,075	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	4,460	4,821	535,839	2044/08/15
US T N/B 8.125 08/15/19	国債証券	8.1250	3,900	4,459	495,615	2019/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	1,080	1,427	158,638	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	3,100	3,645	405,202	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	3,970	4,087	454,321	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	5,000	4,967	552,137	2025/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	6,700	6,929	770,112	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	6,410	6,572	730,438	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	3,600	3,248	361,061	2046/08/15
US T N/B 3.625 08/15/19	国債証券	3.6250	6,200	6,493	721,716	2019/08/15
US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	2.6250	9,350	9,659	1,073,534	2020/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	9,800	9,281	1,031,554	2026/08/15
US T N/B 2.0 08/31/21	国債証券	2.0000	5,200	5,263	584,990	2021/08/31
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	7,900	7,832	870,525	2022/08/15
US T N/B 2.125 08/31/20	国債証券	2.1250	7,680	7,814	868,552	2020/08/31
US T N/B 0.75 08/31/18	国債証券	0.7500	10,000	9,937	1,104,487	2018/08/31
US T N/B 0.75 08/15/19	国債証券	0.7500	7,000	6,906	767,555	2019/08/15
US T N/B 1.0 09/30/19	国債証券	1.0000	10,700	10,607	1,178,875	2019/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	9,800	9,966	1,107,720	2021/09/30
US T N/B 1.0 09/15/18	国債証券	1.0000	10,800	10,760	1,195,942	2018/09/15
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	7,600	7,571	841,496	2022/09/30
US T N/B 2.0 09/30/20	国債証券	2.0000	7,660	7,766	863,165	2020/09/30
US T N/B 0.875 09/15/19	国債証券	0.8750	3,500	3,460	384,567	2019/09/15
US T N/B 1.25 10/31/21	国債証券	1.2500	7,500	7,352	817,137	2021/10/31
US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	1.2500	9,000	8,969	996,819	2019/10/31
US T N/B 1.25 10/31/18	国債証券	1.2500	12,500	12,485	1,387,610	2018/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	2,100	2,657	295,388	2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	700	914	101,598	2028/11/15
US T N/B 6.5 11/15/26	国債証券	6.5000	500	686	76,343	2026/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	950	1,299	144,474	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	3,800	4,013	446,054	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	1,650	2,116	235,257	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	3,400	3,434	381,654	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,850	2,002	222,505	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	3,400	4,085	454,040	2043/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	4,300	4,535	504,110	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	4,000	4,120	457,927	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	6,600	6,703	745,040	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,300	1,690	187,893	2039/11/15

銘柄	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 2.625 11/15/20	国債証券	2.6250	11,860	12,265	1,363,160	2020/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	8,900	9,010	1,001,470	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	7,700	7,787	865,533	2025/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	6,380	6,308	701,096	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	11,100	11,648	1,294,658	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	6,900	6,814	757,395	2026/11/15
US T N/B 1.0 11/30/19	国債証券	1.0000	9,400	9,308	1,034,550	2019/11/30
US T N/B 1.25 11/30/18	国債証券	1.2500	13,500	13,483	1,498,559	2018/11/30
US T N/B 1.0 11/15/19	国債証券	1.0000	10,000	9,902	1,100,586	2019/11/15
US T N/B 1.125 12/31/19	国債証券	1.1250	8,500	8,436	937,670	2019/12/31
US T N/B 2.375 12/31/20	国債証券	2.3750	11,950	12,267	1,363,397	2020/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	12,000	12,204	1,356,392	2021/12/31
US T N/B 1.5 12/31/18	国債証券	1.5000	7,100	7,119	791,311	2018/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	6,000	6,085	676,315	2022/12/31
小計	—	—	675,090	690,990	76,796,664	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.5 02/01/19	国債証券	0.5000	1,900	1,888	157,617	2019/02/01
CANADA 1.75 03/01/19	国債証券	1.7500	400	405	33,870	2019/03/01
CANADA 0.75 03/01/21	国債証券	0.7500	900	890	74,281	2021/03/01
CANADA 1.5 03/01/20	国債証券	1.5000	2,250	2,281	190,411	2020/03/01
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	1,000	971	81,063	2022/03/01
CANADA 0.75 05/01/19	国債証券	0.7500	1,000	997	83,212	2019/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,220	1,229	102,620	2026/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	350	560	46,733	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	990	1,429	119,253	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	1,200	1,853	154,698	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	1,280	1,927	160,836	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,250	1,352	112,828	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	1,470	2,025	169,038	2041/06/01
CANADA 4.25 06/01/18	国債証券	4.2500	300	309	25,830	2018/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.2500	1,400	1,517	126,664	2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	1,850	1,991	166,197	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,300	1,320	110,218	2023/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,250	1,336	111,493	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	1,400	1,337	111,578	2027/06/01
CANADA 3.5 06/01/20	国債証券	3.5000	1,430	1,534	128,016	2020/06/01
CANADA 3.75 06/01/19	国債証券	3.7500	1,350	1,423	118,784	2019/06/01
CANADA 0.5 08/01/18	国債証券	0.5000	2,400	2,390	199,506	2018/08/01
CANADA 0.75 08/01/19	国債証券	0.7500	300	298	24,933	2019/08/01
CANADA 1.25 09/01/18	国債証券	1.2500	1,950	1,959	163,485	2018/09/01
CANADA 1.75 09/01/19	国債証券	1.7500	2,000	2,035	169,862	2019/09/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	1,800	1,774	148,099	2021/09/01
CANADA 0.75 09/01/20	国債証券	0.7500	1,700	1,685	140,696	2020/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	1,540	2,030	169,413	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	1,030	1,210	101,003	2048/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	510	633	52,881	2064/12/01
小計	—	—	38,720	42,601	3,555,135	—
(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	752	63,246	2047/03/21
AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	国債証券	5.2500	2,000	2,121	178,211	2019/03/15
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	2,700	2,886	242,446	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	2,750	3,315	278,491	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	2,510	2,597	218,185	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	2,950	3,395	285,202	2026/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	4.5000	2,200	2,363	198,560	2020/04/15

銘柄	種別	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)						
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	千オーストラリア・ドル 2,550	千オーストラリア・ドル 3,024	千円 254,024	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,450	1,555	130,631	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	1,070	1,308	109,925	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	950	1,057	88,806	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	1,650	1,611	135,342	2028/05/21
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.7500	2,600	2,974	249,869	2021/05/15
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	450	461	38,745	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	730	713	59,932	2035/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	2,250	2,652	222,821	2022/07/15
AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	国債証券	3.2500	1,100	1,123	94,383	2018/10/21
AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	国債証券	2.7500	2,700	2,763	232,118	2019/10/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	1,250	1,279	107,503	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,950	2,001	168,088	2027/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	国債証券	1.7500	2,700	2,690	225,976	2020/11/21
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券	2.0000	1,200	1,201	100,918	2021/12/21
小計	-	-	40,510	43,850	3,683,432	-
(シンガポール)						
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 740	千シンガポール・ドル 839	千円 67,186	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	250	272	21,857	2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	420	458	36,689	2042/04/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	300	311	24,933	2025/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	200	216	17,351	2029/07/01
SINGAPORE 4.0 09/01/18	国債証券	4.0000	830	858	68,770	2018/09/01
SINGAPORE 3.25 09/01/20	国債証券	3.2500	980	1,039	83,247	2020/09/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	1,240	1,341	107,428	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	600	647	51,837	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	370	400	32,036	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	270	311	24,904	2033/09/01
SINGAPORE 1.25 10/01/21	国債証券	1.2500	800	795	63,671	2021/10/01
SINGAPORE 1.625 10/01/19	国債証券	1.6250	500	504	40,415	2019/10/01
小計	-	-	7,500	7,997	640,330	-
(イギリス)						
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	千イギリス・ポンド 2,290	千イギリス・ポンド 3,034	千円 427,434	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	2,150	2,993	421,686	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	1,360	2,405	338,853	2060/01/22
UK TREASURY 1.5 01/22/21	国債証券	1.5000	2,500	2,608	367,424	2021/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,550	2,046	288,307	2025/03/07
UK TREASURY 4.5 03/07/19	国債証券	4.5000	1,200	1,288	181,502	2019/03/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	4.0000	1,200	1,404	197,916	2022/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	2,100	3,006	423,535	2036/03/07
UK TREASURY 4.75 03/07/20	国債証券	4.7500	1,800	2,023	285,033	2020/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,450	2,006	282,657	2032/06/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国債証券	8.0000	1,520	1,985	279,643	2021/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,450	1,389	195,723	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	1,530	2,403	338,599	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	950	1,003	141,320	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	1,570	2,091	294,568	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	1,460	2,485	350,194	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	2,250	2,357	332,044	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	450	456	64,304	2027/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/18	国債証券	1.2500	1,950	1,972	277,828	2018/07/22
UK TREASURY 2.0 07/22/20	国債証券	2.0000	2,150	2,266	319,252	2020/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	1,800	1,802	253,870	2022/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/19	国債証券	1.7500	4,150	4,284	603,528	2019/07/22
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	1,440	2,127	299,694	2039/09/07

銘柄	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 3.75 09/07/21	国債証券	3.7500	1,200	1,373	193,494	2021/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	1,850	2,036	286,865	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	1,700	1,944	273,940	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	2,150	2,351	331,228	2025/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/20	国債証券	3.7500	2,300	2,561	360,807	2020/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/19	国債証券	3.7500	1,170	1,262	177,838	2019/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	2,000	2,900	408,607	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	800	811	114,363	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	2,720	2,901	408,685	2022/09/07
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	1,000	1,526	215,038	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	1,500	2,345	330,396	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,830	2,895	407,827	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,580	2,513	354,049	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,600	2,838	399,867	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	1,500	1,979	278,880	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,600	2,395	337,456	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,250	1,785	251,558	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	1,430	2,363	332,926	2049/12/07
小計	-	-	69,450	88,228	12,428,758	-
(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	12,300	20,967	349,523	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	7,300	8,220	137,037	2025/11/15
DENMARK 4.0 11/15/19	国債証券	4.0000	11,310	12,536	208,975	2019/11/15
DENMARK 3.0 11/15/21	国債証券	3.0000	8,830	10,093	168,252	2021/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	6,570	7,204	120,106	2023/11/15
DENMARK 0.25 11/15/18	国債証券	0.2500	1,000	1,011	16,867	2018/11/15
小計	-	-	47,310	60,033	1,000,762	-
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	3,000	3,019	39,314	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	1,600	1,635	21,295	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	4,400	4,896	63,754	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,100	3,190	41,541	2025/03/13
NORWAY 4.5 05/22/19	国債証券	4.5000	6,200	6,655	86,649	2019/05/22
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	5,600	5,873	76,478	2023/05/24
NORWAY 3.75 05/25/21	国債証券	3.7500	6,560	7,282	94,823	2021/05/25
小計	-	-	30,460	32,554	423,857	-
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	4.2500	9,580	10,398	131,960	2019/03/12
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	5,210	7,178	91,089	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	3,000	3,024	38,374	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	5,500	6,460	81,986	2025/05/12
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	9,580	11,318	143,636	2022/06/01
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	7,400	8,072	102,438	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	4,600	4,823	61,210	2026/11/12
SWEDEN 5.0 12/01/20	国債証券	5.0000	9,240	10,983	139,386	2020/12/01
小計	-	-	54,110	62,260	790,082	-
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	10,000	9,239	56,357	2026/03/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	9,000	10,114	61,699	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	13,940	14,837	90,510	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	12,000	12,468	76,057	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	7,500	7,372	44,974	2022/06/09
MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	国債証券	6.5000	35,860	35,370	215,762	2021/06/10
MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	8.0000	20,000	20,591	125,605	2020/06/11
MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	国債証券	4.7500	18,450	18,050	110,110	2018/06/14

銘柄	種別	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)						
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	千メキシコ・ペソ 20,880	千メキシコ・ペソ 22,301	千円 136,040	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	11,820	13,567	82,759	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	9,880	12,875	78,537	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	3,000	3,202	19,536	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	25,720	30,303	184,848	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	12,500	13,204	80,549	2023/12/07
MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	国債証券	8.5000	24,000	24,492	149,404	2018/12/13
MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	国債証券	5.0000	13,000	12,442	75,896	2019/12/11
小計	-	-	247,550	260,434	1,588,651	-
(マレーシア)						
MALAYSIA 4.392 04/15/23	国債証券	3.4800	千マレーシア・リンギット 2,190	千マレーシア・リンギット 2,150	千円 55,771	2023/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,480	1,517	39,364	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	2,820	2,859	74,175	2030/04/15
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,180	1,142	29,644	2032/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	340	321	8,327	2033/04/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	1,580	1,503	39,008	2027/05/31
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.1600	3,960	4,038	104,756	2021/07/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	690	702	18,230	2024/07/15
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,480	1,627	42,216	2028/09/15
MALAYSIA 3.58 09/28/18	国債証券	3.5800	2,170	2,179	56,523	2018/09/28
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,720	1,773	45,994	2043/09/30
MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	4.3780	5,760	5,887	152,726	2019/11/29
小計	-	-	25,370	25,703	666,739	-
(南アフリカ)						
SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	国債証券	8.0000	千南アフリカ・ランド 6,020	千南アフリカ・ランド 5,516	千円 46,894	2030/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8.7500	13,000	11,732	99,727	2044/01/31
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8.5000	5,100	4,574	38,880	2037/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8.7500	11,460	10,332	87,824	2048/02/28
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6.5000	7,780	5,485	46,624	2041/02/28
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	8,690	7,190	61,115	2031/02/28
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8.2500	6,000	5,487	46,646	2032/03/31
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6.2500	12,410	8,847	75,200	2036/03/31
SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	国債証券	6.7500	16,150	15,705	133,493	2021/03/31
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10.5000	24,940	28,021	238,185	2026/12/21
小計	-	-	111,550	102,893	874,593	-
(ポーランド)						
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 900	千ポーランド・ズロチ 1,128	千円 32,916	2029/04/25
POLAND 2.0 04/25/21	国債証券	2.0000	2,500	2,466	71,915	2021/04/25
POLAND 1.5 04/25/20	国債証券	1.5000	1,500	1,476	43,066	2020/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	3,500	3,337	97,329	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	3,600	3,657	106,662	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	1,600	1,507	43,949	2027/07/25
POLAND 1.75 07/25/21	国債証券	1.7500	2,000	1,948	56,809	2021/07/25
POLAND 3.25 07/25/19	国債証券	3.2500	5,800	5,958	173,745	2019/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	3,380	3,892	113,492	2022/09/23
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.2500	2,880	3,157	92,068	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.7500	1,780	2,019	58,901	2021/10/25
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	2,570	2,752	80,258	2023/10/25
POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	5.5000	2,110	2,280	66,499	2019/10/25
POLAND 10/25/18	国債証券	-	1,500	1,466	42,768	2018/10/25
小計	-	-	35,620	37,050	1,080,384	-
(ユーロ圏・アイルランド)						
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	千ユーロ 630	千ユーロ 664	千円 82,411	2045/02/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	770	935	115,964	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	1,020	1,405	174,323	2025/03/13

銘	柄	種	類	利	率	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 3.9	03/20/23	国	債 証 券	3.9000	550	673	83,561		2023/03/20
IRISH 0.8	03/15/22	国	債 証 券	0.8000	790	826	102,493		2022/03/15
IRISH 4.5	04/18/20	国	債 証 券	4.5000	1,070	1,218	151,165		2020/04/18
IRISH 2.4	05/15/30	国	債 証 券	2.4000	860	995	123,456		2030/05/15
IRISH 1.0	05/15/26	国	債 証 券	1.0000	1,000	1,029	127,690		2026/05/15
IRISH 1.7	05/15/37	国	債 証 券	1.7000	300	309	38,332		2037/05/15
IRISH 4.4	06/18/19	国	債 証 券	4.4000	690	755	93,750		2019/06/18
IRISH 5.0	10/18/20	国	債 証 券	5.0000	780	919	114,095		2020/10/18
IRISH 4.5	10/18/18	国	債 証 券	4.5000	490	521	64,727		2018/10/18
IRISH 5.9	10/18/19	国	債 証 券	5.9000	740	849	105,343		2019/10/18
小	計	-	-	-	9,690	11,105	1,377,318		-
(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	1,540	2,471	306,505		2042/01/15
NETHERLANDS 2.75	01/15/47	国	債 証 券	2.7500	1,120	1,588	196,959		2047/01/15
NETHERLANDS 3.75	01/15/23	国	債 証 券	3.7500	1,090	1,335	165,597		2023/01/15
NETHERLANDS 5.5	01/15/28	国	債 証 券	5.5000	1,220	1,861	230,814		2028/01/15
NETHERLANDS 4.0	01/15/37	国	債 証 券	4.0000	1,430	2,242	278,153		2037/01/15
NETHERLANDS 2.5	01/15/33	国	債 証 券	2.5000	1,250	1,573	195,176		2033/01/15
NETHERLANDS 1.25	01/15/19	国	債 証 券	1.2500	1,500	1,544	191,575		2019/01/15
NETHERLANDS	01/15/22	国	債 証 券	-	1,830	1,859	230,567		2022/01/15
NETHERLANDS 0.25	01/15/20	国	債 証 券	0.2500	1,550	1,584	196,477		2020/01/15
NETHERLANDS 3.5	07/15/20	国	債 証 券	3.5000	1,380	1,552	192,558		2020/07/15
NETHERLANDS 3.25	07/15/21	国	債 証 券	3.2500	1,450	1,670	207,145		2021/07/15
NETHERLANDS 1.75	07/15/23	国	債 証 券	1.7500	1,550	1,728	214,429		2023/07/15
NETHERLANDS 0.5	07/15/26	国	債 証 券	0.5000	1,500	1,525	189,229		2026/07/15
NETHERLANDS 4.0	07/15/18	国	債 証 券	4.0000	1,290	1,353	167,921		2018/07/15
NETHERLANDS 2.25	07/15/22	国	債 証 券	2.2500	1,660	1,877	232,817		2022/07/15
NETHERLANDS 2.0	07/15/24	国	債 証 券	2.0000	1,580	1,803	223,710		2024/07/15
NETHERLANDS 0.25	07/15/25	国	債 証 券	0.2500	1,500	1,511	187,436		2025/07/15
NETHERLANDS 4.0	07/15/19	国	債 証 券	4.0000	1,170	1,282	159,033		2019/07/15
NETHERLANDS 0.75	07/15/27	国	債 証 券	0.7500	750	771	95,676		2027/07/15
小	計	-	-	-	26,360	31,138	3,861,785		-
(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	1,830	2,209	273,977		2022/03/28
BELGIUM 5.5	03/28/28	国	債 証 券	5.5000	2,000	3,041	377,258		2028/03/28
BELGIUM 4.25	03/28/41	国	債 証 券	4.2500	1,670	2,660	329,944		2041/03/28
BELGIUM 4.0	03/28/19	国	債 証 券	4.0000	1,080	1,168	144,907		2019/03/28
BELGIUM 4.5	03/28/26	国	債 証 券	4.5000	850	1,161	144,010		2026/03/28
BELGIUM 4.0	03/28/32	国	債 証 券	4.0000	710	1,013	125,726		2032/03/28
BELGIUM 5.0	03/28/35	国	債 証 券	5.0000	1,850	3,041	377,242		2035/03/28
BELGIUM 3.75	06/22/45	国	債 証 券	3.7500	830	1,257	155,976		2045/06/22
BELGIUM 1.6	06/22/47	国	債 証 券	1.6000	480	481	59,754		2047/06/22
BELGIUM 2.25	06/22/57	国	債 証 券	2.2500	200	224	27,820		2057/06/22
BELGIUM 2.15	06/22/66	国	債 証 券	2.1500	440	475	58,988		2066/06/22
BELGIUM 1.0	06/22/26	国	債 証 券	1.0000	1,400	1,472	182,680		2026/06/22
BELGIUM 2.6	06/22/24	国	債 証 券	2.6000	1,500	1,763	218,735		2024/06/22
BELGIUM 1.0	06/22/31	国	債 証 券	1.0000	1,090	1,098	136,210		2031/06/22
BELGIUM 2.25	06/22/23	国	債 証 券	2.2500	1,250	1,429	177,236		2023/06/22
BELGIUM 3.0	06/22/34	国	債 証 券	3.0000	580	756	93,836		2034/06/22
BELGIUM 1.9	06/22/38	国	債 証 券	1.9000	800	892	110,715		2038/06/22
BELGIUM 0.8	06/22/25	国	債 証 券	0.8000	1,650	1,720	213,356		2025/06/22
BELGIUM 0.8	06/22/27	国	債 証 券	0.8000	700	714	88,565		2027/06/22
BELGIUM 1.25	06/22/18	国	債 証 券	1.2500	900	916	113,700		2018/06/22
BELGIUM 1.45	06/22/37	国	債 証 券	1.4500	350	360	44,768		2037/06/22
BELGIUM 4.25	09/28/21	国	債 証 券	4.2500	1,450	1,739	215,721		2021/09/28

銘	柄	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)							
BELGIUM 3.75 09/28/20		国債証券	3.7500	2,000	千ユーロ	千円	2020/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/22		国債証券	4.2500	1,550	2,280	282,830	2022/09/28
BELGIUM 3.0 09/28/19		国債証券	3.0000	1,130	1,919	238,028	2019/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24		国債証券	0.5000	300	1,222	151,593	2024/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23		国債証券	0.2000	360	307	38,097	2023/10/22
小計		-	-	28,950	35,695	4,426,952	-
(ユーロ…フランス)							
FRANCE OAT 02/25/19		国債証券	-	3,150	千ユーロ	千円	2019/02/25
FRANCE OAT 3.75 04/25/21		国債証券	3.7500	3,050	3,179	394,374	2021/04/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23		国債証券	8.5000	1,480	3,542	439,387	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26		国債証券	3.5000	2,870	2,230	276,567	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41		国債証券	4.5000	3,150	3,646	452,254	2026/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55		国債証券	4.0000	1,380	5,146	638,284	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60		国債証券	4.0000	1,250	2,264	280,818	2055/04/25
FRANCE OAT 4.25 04/25/19		国債証券	4.2500	1,990	2,109	261,558	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29		国債証券	5.5000	2,750	2,168	268,895	2019/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22		国債証券	3.0000	3,600	4,241	526,073	2029/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/20		国債証券	3.5000	3,000	4,173	517,541	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35		国債証券	4.7500	2,500	3,343	414,679	2020/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45		国債証券	3.2500	2,350	3,970	492,455	2035/04/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66		国債証券	1.7500	1,340	3,266	405,088	2045/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24		国債証券	2.2500	3,400	1,329	164,837	2066/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30		国債証券	2.5000	3,300	3,917	485,807	2024/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31		国債証券	1.5000	3,210	3,957	490,865	2030/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25		国債証券	0.5000	3,350	3,439	426,504	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26		国債証券	0.5000	2,500	3,413	423,315	2025/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/19		国債証券	1.0000	3,570	2,513	311,755	2026/05/25
FRANCE OAT 05/25/20		国債証券	-	3,700	3,677	456,104	2019/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/23		国債証券	1.7500	3,850	3,752	465,385	2020/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36		国債証券	1.2500	1,900	4,271	529,703	2023/05/25
FRANCE OAT 05/25/22		国債証券	-	2,600	1,893	234,883	2036/05/25
FRANCE OAT 05/25/21		国債証券	-	3,200	2,628	326,008	2022/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39		国債証券	1.7500	610	3,245	402,499	2021/05/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23		国債証券	4.2500	3,560	655	81,238	2039/06/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25		国債証券	6.0000	2,300	4,535	562,463	2023/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27		国債証券	2.7500	3,950	3,399	421,593	2025/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38		国債証券	4.0000	2,500	4,791	594,282	2027/10/25
FRANCE OAT 3.25 10/25/21		国債証券	3.2500	3,600	3,773	467,946	2038/10/25
FRANCE OAT 8.5 10/25/19		国債証券	8.5000	1,480	4,165	516,545	2021/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32		国債証券	5.7500	2,950	1,796	222,763	2019/10/25
FRANCE OAT 2.25 10/25/22		国債証券	2.2500	2,000	4,958	614,935	2032/10/25
FRANCE OAT 3.75 10/25/19		国債証券	3.7500	2,460	2,260	280,381	2022/10/25
FRANCE OAT 2.5 10/25/20		国債証券	2.5000	2,900	2,709	336,077	2019/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24		国債証券	1.7500	3,200	3,189	395,555	2020/10/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25		国債証券	1.0000	3,500	3,578	443,836	2024/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26		国債証券	0.2500	3,400	3,691	457,835	2025/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/18		国債証券	1.0000	3,800	3,313	410,881	2026/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/20		国債証券	0.2500	4,000	3,886	481,969	2018/11/25
FRANCE OAT 0.5 11/25/19		国債証券	0.5000	3,100	4,094	507,747	2020/11/25
小計		-	-	117,750	139,297	17,275,682	-
(ユーロ…ドイツ)							
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24		国債証券	6.2500	1,180	千ユーロ	千円	2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28		国債証券	5.6250	1,300	1,677	207,984	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30		国債証券	6.2500	850	2,015	249,913	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31		国債証券	5.5000	1,690	1,450	179,886	2031/01/04

銘柄	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 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	2,260	3,575	443,430	2037/01/04
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2.0000	2,000	2,224	275,820	2022/01/04
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	国債証券	3.7500	2,400	2,564	318,102	2019/01/04
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債証券	3.2500	2,300	2,529	313,719	2020/01/04
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	国債証券	2.5000	2,300	2,551	316,423	2021/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	2,770	2,882	357,486	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	2,400	2,481	307,768	2026/02/15
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	1,800	1,983	245,954	2023/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,850	2,088	259,055	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,450	2,446	303,381	2027/02/15
BUNDESobl 1.0 02/22/19	国債証券	1.0000	1,200	1,233	153,025	2019/02/22
BUNDESobl 0.5 04/12/19	国債証券	0.5000	1,750	1,786	221,586	2019/04/12
BUNDESobl 04/17/20	国債証券	-	2,250	2,290	284,034	2020/04/17
BUNDESobl 04/09/21	国債証券	-	2,250	2,294	284,617	2021/04/09
BUNDESobl 04/08/22	国債証券	-	300	305	37,895	2022/04/08
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,500	1,669	207,099	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	1,970	2,176	269,889	2023/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,170	1,893	234,881	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,200	1,769	219,436	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,310	2,200	272,878	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,420	2,142	265,756	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,000	2,693	333,995	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,550	2,800	347,369	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.2500	1,700	1,961	243,218	2021/07/04
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3.0000	1,400	1,554	192,808	2020/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	2,450	2,714	336,616	2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	国債証券	4.2500	1,200	1,261	156,472	2018/07/04
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	国債証券	3.5000	1,410	1,530	189,754	2019/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,810	2,992	371,070	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,210	3,014	373,834	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	2,450	2,643	327,886	2025/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	-	2,320	2,282	283,016	2026/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	1,800	2,048	254,062	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,750	1,889	234,297	2024/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	1,600	1,786	221,513	2021/09/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2.2500	1,900	2,074	257,255	2020/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	1,500	1,645	204,136	2022/09/04
BUNDESSCHAT 09/14/18	国債証券	-	4,000	4,033	500,256	2018/09/14
BUNDESobl 10/08/21	国債証券	-	2,600	2,651	328,862	2021/10/08
BUNDESobl 1.0 10/12/18	国債証券	1.0000	1,050	1,073	133,089	2018/10/12
BUNDESobl 0.25 10/16/20	国債証券	0.2500	1,700	1,746	216,653	2020/10/16
BUNDESobl 0.25 10/11/19	国債証券	0.2500	2,300	2,347	291,110	2019/10/11
BUNDESSCHAT 12/14/18	国債証券	-	2,000	2,020	250,520	2018/12/14
小計	-	-	86,570	101,788	12,623,791	-
(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	1,550	1,961	243,301	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,800	2,648	328,478	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,980	2,516	312,035	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,900	2,492	309,098	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,900	2,433	301,861	2023/01/31
SPAIN 1.4 01/31/20	国債証券	1.4000	3,100	3,235	401,328	2020/01/31
SPAIN 0.25 01/31/19	国債証券	0.2500	2,600	2,622	325,286	2019/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,900	1,994	247,318	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,950	2,352	291,698	2024/04/30
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.5000	2,000	2,432	301,643	2021/04/30

銘	柄	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 4.0 04/30/20		国債証券	4.0000	2,070	2,320	287,769	2020/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27		国債証券	1.5000	2,050	2,072	257,063	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26		国債証券	1.9500	2,100	2,238	277,612	2026/04/30
SPAIN 2.75 04/30/19		国債証券	2.7500	2,500	2,641	327,651	2019/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22		国債証券	0.4000	2,100	2,122	263,210	2022/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26		国債証券	5.9000	1,340	1,883	233,557	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40		国債証券	4.9000	1,520	2,192	271,926	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41		国債証券	4.7000	1,500	2,119	262,823	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66		国債証券	3.4500	450	499	61,926	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25		国債証券	4.6500	1,950	2,503	310,521	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30		国債証券	1.9500	1,840	1,882	233,481	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32		国債証券	5.7500	1,900	2,865	355,337	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33		国債証券	2.3500	600	622	77,202	2033/07/30
SPAIN 4.6 07/30/19		国債証券	4.6000	1,810	1,996	247,550	2019/07/30
SPAIN 0.75 07/30/21		国債証券	0.7500	2,300	2,375	294,636	2021/07/30
SPAIN 1.15 07/30/20		国債証券	1.1500	1,900	1,981	245,742	2020/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24		国債証券	2.7500	2,300	2,615	324,324	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28		国債証券	5.1500	2,250	3,078	381,789	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44		国債証券	5.1500	1,080	1,623	201,332	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46		国債証券	2.9000	1,070	1,126	139,725	2046/10/31
SPAIN 4.85 10/31/20		国債証券	4.8500	1,400	1,636	202,941	2020/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25		国債証券	2.1500	2,160	2,343	290,591	2025/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26		国債証券	1.3000	1,990	2,000	248,154	2026/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23		国債証券	4.4000	2,070	2,569	318,691	2023/10/31
SPAIN 4.3 10/31/19		国債証券	4.3000	1,720	1,905	236,277	2019/10/31
SPAIN 3.75 10/31/18		国債証券	3.7500	2,950	3,117	386,573	2018/10/31
小計		-	-	67,600	79,023	9,800,466	-
(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	2,520	2,701	334,995	2019/02/01
ITALY BTPS 4.5 02/01/20		国債証券	4.5000	1,820	2,032	252,034	2020/02/01
ITALY BTPS 5.75 02/01/33		国債証券	5.7500	1,600	2,294	284,571	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37		国債証券	4.0000	2,400	2,902	359,945	2037/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47		国債証券	2.7000	1,250	1,171	145,273	2047/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24		国債証券	4.5000	2,000	2,418	299,920	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67		国債証券	2.8000	700	610	75,762	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25		国債証券	5.0000	2,000	2,511	311,471	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/19		国債証券	4.5000	2,700	2,915	361,548	2019/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22		国債証券	5.0000	2,200	2,646	328,231	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26		国債証券	4.5000	1,550	1,904	236,194	2026/03/01
ITALY BTPS 4.25 03/01/20		国債証券	4.2500	2,100	2,336	289,819	2020/03/01
ITALY BTPS 3.75 03/01/21		国債証券	3.7500	2,450	2,766	343,136	2021/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32		国債証券	1.6500	2,000	1,841	228,397	2032/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30		国債証券	3.5000	2,680	3,064	380,029	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23		国債証券	0.9500	2,200	2,205	273,526	2023/03/15
ITALY BTPS 1.35 04/15/22		国債証券	1.3500	2,000	2,066	256,331	2022/04/15
ITALY BTPS 0.1 04/15/19		国債証券	0.1000	5,100	5,128	636,025	2019/04/15
ITALY BTPS 6.0 05/01/31		国債証券	6.0000	2,850	4,112	510,073	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23		国債証券	4.5000	2,600	3,122	387,306	2023/05/01
ITALY BTPS 2.5 05/01/19		国債証券	2.5000	1,000	1,049	130,187	2019/05/01
ITALY BTPS 0.7 05/01/20		国債証券	0.7000	2,300	2,340	290,266	2020/05/01
ITALY BTPS 3.75 05/01/21		国債証券	3.7500	2,500	2,829	350,852	2021/05/01
ITALY BTPS 1.6 06/01/26		国債証券	1.6000	2,000	1,983	246,006	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25		国債証券	1.5000	2,000	1,995	247,464	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27		国債証券	2.2000	1,500	1,540	191,071	2027/06/01
ITALY BTPS 0.45 06/01/21		国債証券	0.4500	3,750	3,768	467,400	2021/06/01

銘	柄	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)							
ITALY BTPS 0.35 06/15/20		国債証券	0.3500	1,100	千ユーロ	千円	2020/06/15
ITALY BTPS 3.75 08/01/21		国債証券	3.7500	2,000	2,107	137,375	2021/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34		国債証券	5.0000	2,370	2,273	281,947	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39		国債証券	5.0000	2,100	3,185	395,097	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23		国債証券	4.7500	2,100	2,861	354,930	2023/08/01
ITALY BTPS 1.5 08/01/19		国債証券	1.5000	2,500	2,567	318,390	2019/08/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44		国債証券	4.7500	1,800	2,585	320,607	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46		国債証券	3.2500	1,600	2,376	294,740	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28		国債証券	4.7500	2,200	1,675	207,811	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40		国債証券	5.0000	2,080	2,793	346,454	2040/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21		国債証券	4.7500	2,200	2,811	348,635	2021/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33		国債証券	2.4500	700	2,594	321,819	2033/09/01
ITALY BTPS 4.0 09/01/20		国債証券	4.0000	2,660	700	86,889	2020/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24		国債証券	3.7500	1,900	2,989	370,700	2024/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22		国債証券	5.5000	2,360	2,207	273,834	2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36		国債証券	2.2500	1,400	2,931	363,502	2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22		国債証券	1.4500	1,350	1,330	165,016	2022/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23		国債証券	0.6500	2,300	1,396	173,224	2023/10/15
ITALY BTPS 0.3 10/15/18		国債証券	0.3000	3,150	2,237	277,435	2018/10/15
ITALY BTPS 9.0 11/01/23		国債証券	9.0000	1,270	3,175	393,846	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26		国債証券	7.2500	900	1,884	233,675	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27		国債証券	6.5000	2,400	1,329	164,915	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29		国債証券	5.2500	2,230	3,427	425,041	2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22		国債証券	5.5000	1,700	2,979	369,517	2022/11/01
ITALY BTPS 0.35 11/01/21		国債証券	0.3500	3,100	2,116	262,473	2021/11/01
ITALY BTPS 2.0 12/01/25		国債証券	2.0000	2,100	3,087	382,851	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26		国債証券	1.2500	1,800	2,161	268,072	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24		国債証券	2.5000	2,050	1,721	213,547	2024/12/01
ITALY BTPS 1.05 12/01/19		国債証券	1.0500	4,800	2,202	273,131	2019/12/01
小計		-	-	119,990	135,898	16,854,112	-
(ユーロ…フィンランド)							
FINLAND 2.0 04/15/24		国債証券	2.0000	500	千ユーロ	千円	2024/04/15
FINLAND 3.5 04/15/21		国債証券	3.5000	560	567	70,337	2021/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31		国債証券	0.7500	400	644	79,875	2031/04/15
FINLAND 3.375 04/15/20		国債証券	3.3750	730	399	49,559	2020/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26		国債証券	0.5000	430	810	100,524	2026/04/15
FINLAND 1.5 04/15/23		国債証券	1.5000	600	437	54,227	2023/04/15
FINLAND 04/15/22		国債証券	-	450	656	81,414	2022/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25		国債証券	4.0000	470	455	56,523	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28		国債証券	2.7500	440	615	76,276	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42		国債証券	2.6250	420	544	67,520	2042/07/04
FINLAND 4.375 07/04/19		国債証券	4.3750	460	564	69,990	2019/07/04
FINLAND 0.875 09/15/25		国債証券	0.8750	520	506	62,840	2025/09/15
FINLAND 1.625 09/15/22		国債証券	1.6250	450	547	67,919	2022/09/15
FINLAND 1.125 09/15/18		国債証券	1.1250	330	493	61,194	2018/09/15
FINLAND 09/15/23		国債証券	-	490	337	41,829	2023/09/15
FINLAND 0.375 09/15/20		国債証券	0.3750	380	490	60,882	2020/09/15
小計		-	-	7,630	8,460	1,049,314	-
(ユーロ…オーストリア)							
AUSTRIA 3.8 01/26/62		国債証券	3.8000	360	千ユーロ	千円	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47		国債証券	1.5000	360	626	77,758	2047/02/20
AUSTRIA 4.35 03/15/19		国債証券	4.3500	1,030	370	45,983	2019/03/15
AUSTRIA 4.85 03/15/26		国債証券	4.8500	950	1,118	138,661	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37		国債証券	4.1500	1,100	1,327	164,641	2037/03/15
AUSTRIA 3.65 04/20/22		国債証券	3.6500	1,050	1,703	211,249	2022/04/20

銘柄	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…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	630	774	96,051	2034/05/23
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	650	927	115,008	2044/06/20
AUSTRIA 1.95 06/18/19	国債証券	1.9500	660	692	85,938	2019/06/18
AUSTRIA 3.9 07/15/20	国債証券	3.9000	1,350	1,531	189,920	2020/07/15
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	760	1,200	148,850	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	-	750	751	93,238	2023/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	1,390	1,617	200,659	2021/09/15
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	930	1,034	128,266	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,590	1,637	203,068	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	830	894	110,936	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	830	925	114,753	2023/10/20
AUSTRIA 1.15 10/19/18	国債証券	1.1500	420	429	53,290	2018/10/19
AUSTRIA 0.25 10/18/19	国債証券	0.2500	730	743	92,204	2019/10/18
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	980	1,171	145,335	2022/11/22
小 計	-	-	17,350	20,728	2,570,800	-
合 計	-	-	-	-	173,369,615	-

■投資信託財産の構成

2017年6月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 173,369,615	% 97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,643,547	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	178,013,162	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) 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、174,837,785千円、98.2%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6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=111.14円、1カナダ・ドル=83.45円、1オーストラリア・ドル=84.00円、1シンガポール・ドル=80.07円、1イギリス・ポンド=140.87円、1デンマーク・クローネ=16.67円、1ノルウェー・クローネ=13.02円、1スウェーデン・クローナ=12.69円、1メキシコ・ペソ=6.10円、1マレーシア・リンギット=25.94円、1南アフリカ・ランド=8.50円、1ポーランド・ズロチ=29.16円、1ユーロ=124.02円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	351,155,968,686円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,928,432,153
公 社 債(評価額)	173,369,615,837
未 収 入 金	173,536,970,626
未 収 利 息	1,189,045,085
未 前 払 費 用	131,904,985
(B) 負 債	174,126,288,085
未 払 金	173,822,914,085
未 払 解 約 金	303,374,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	177,029,680,601
元 本	131,360,464,925
次 期 繰 越 損 益 金	45,669,215,676
(D) 受 益 権 総 口 数	131,360,464,925口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,477円

(注1) 期首元本額 120,863,866,770円
 追加設定元本額 70,614,923,332円
 一部解約元本額 60,118,325,177円

(注2) 期末における元本の内訳
 たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>
 507,617,233円
 投資のソムリエ 13,964,235,816円
 投資のソムリエ<DC年金> 682,312,291円
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 360,345,395円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 3,584,028,995円
 ワールドアセットバランス(基本コース) 2,475,643,772円
 ワールドアセットバランス(リスク抑制コース) 4,459,825,284円
 外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ) (適格機関投資家限定)
 2,676,088,257円
 D I AM世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)
 20,975,592,221円
 D I AM世界アセットバランスファンド40 V A (適格機関投資家限定)
 1,130,160,506円
 D I AM世界アセットバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)
 7,147,452,063円
 D I AM世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)
 33,537,655,984円
 D I AMバランス30 V A (適格機関投資家限定) 32,902,978円
 D I AM世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)
 29,970,540,551円
 D I AMバランス20 V A (適格機関投資家限定) 177,835,832円
 D I AM世界アセットバランスファンド7 V A (1212) (適格機関投資家限定)
 2,945,681,231円
 D I AM世界アセットバランスファンド7 V A (1303) (適格機関投資家限定)
 2,712,061,726円
 D I AM世界アセットバランスファンド7 V A (1306) (適格機関投資家限定)
 3,563,285,139円
 D I AM世界アセットバランスファンド7 V A (1309) (適格機関投資家限定)
 457,199,651円
 期末元本合計 131,360,464,925円

■損益の状況

当期 自2016年6月23日 至2017年6月22日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,863,491,848円
受 取 利 息	3,865,542,948
支 払 利 息	△2,051,100
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,760,204,358
売 買 益	34,339,822,768
売 買 損	△39,100,027,126
(C) そ の 他 費 用	△18,635,217
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△915,347,727
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	43,822,815,558
(F) 解 約 差 損 益 金	△22,059,110,823
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	24,820,858,668
(H) 合 計(D+E+F+G)	45,669,215,676
次 期 繰 越 損 益 金(H)	45,669,215,676

(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)