

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	信託期間は2010年4月6日から無期限です。	
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	外国債券インデックスe	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外国債券インデックスe	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限り、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	外国債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限り、取得時において株式への投資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。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。	

外国債券インデックスe

運用報告書(全体版)

第5期(決算日 2015年2月9日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

お問い合わせ先

フリーダイヤル:0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

PCサイト <http://www.smtam.jp/>

モバイルサイト <http://m.smtam.jp/>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574 東京都港区芝三丁目33番1号

【本運用報告書の記載について】

- ・ 基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組比	債券先比率	債券先物率	純資産総額
	(分配落)	税金 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
設定日(2010年4月6日)	円 10,000	円 -	% -		317.381	% -	% -	% -	百万円 1
第1期(2011年2月7日)	8,891	0	△11.1		280.388	△11.7	97.3	0.9	305
第2期(2012年2月7日)	8,855	0	△0.4		281.993	0.6	97.5	1.0	901
第3期(2013年2月7日)	11,307	0	27.7		362.920	28.7	98.2	0.4	1,687
第4期(2014年2月7日)	12,473	20	10.5		402.308	10.9	96.5	1.6	2,412
第5期(2015年2月9日)	14,389	20	15.5		469.338	16.7	96.8	1.6	3,891

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首) 2014年 2月 7日	円 12,473	% -		402.308	% -	% 1.6
2月末	12,623	1.2		407.861	1.4	97.3 0.9
3月末	12,799	2.6		413.385	2.8	97.2 1.0
4月末	12,858	3.1		415.471	3.3	97.6 0.7
5月末	12,798	2.6		413.818	2.9	97.9 0.6
6月末	12,845	3.0		415.582	3.3	96.5 1.6
7月末	12,962	3.9		419.355	4.2	96.9 1.2
8月末	13,165	5.5		426.420	6.0	97.6 0.9
9月末	13,534	8.5		438.138	8.9	98.1 0.4
10月末	13,553	8.7		438.300	8.9	97.0 1.3
11月末	14,695	17.8		475.708	18.2	97.0 1.4
12月末	14,847	19.0		482.546	19.9	96.4 1.4
2015年 1月末	14,393	15.4		467.265	16.1	96.5 1.6
(当期末) 2015年 2月 9日	円 14,409	% 15.5		469.338	16.7	96.8 1.6

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

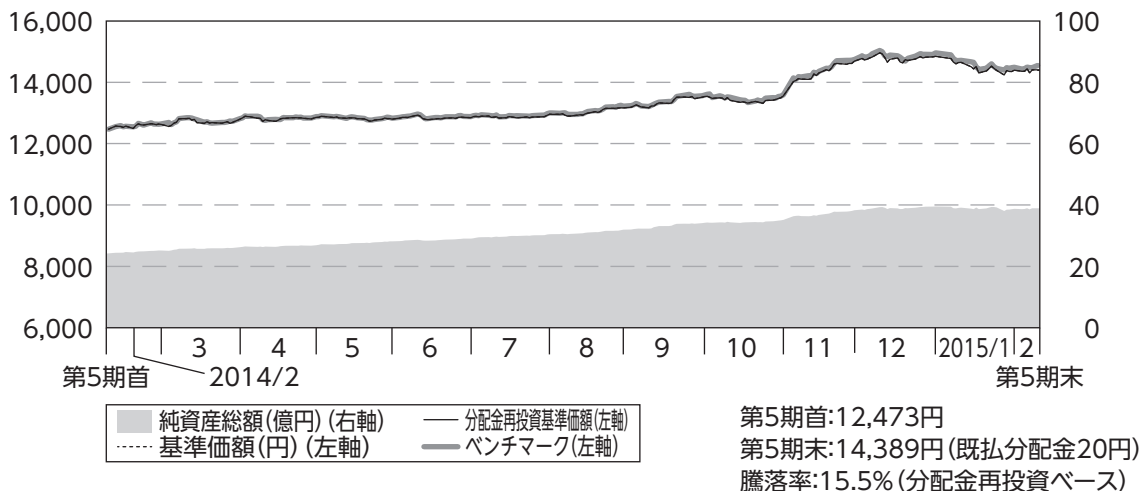
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

ベンチマークは、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)です。

シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に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様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様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及びベンチマークは、2014年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

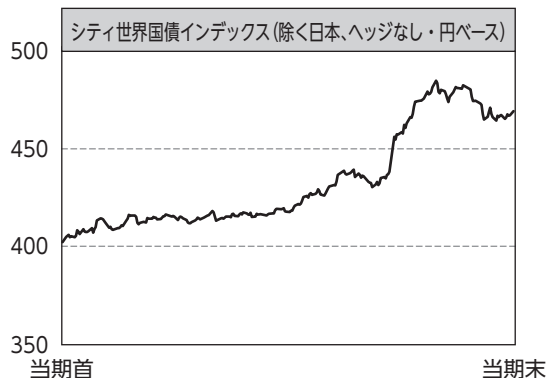
基準価額の主な変動要因

期初より2014年8月末まで、外国為替市場での安定的推移が続いた一方、債券市場ではECB(欧州中央銀行)の利下げ実施やウクライナや中東での地政学的リスクの高まりなどを背景にした債券需要により債券価格が上昇し、基準価額は緩やかに上昇しました。その後も原油価格下落を背景とした世界的な低インフレ傾向、ECBによる量的金融緩和の実施やギリシャ情勢の不透明感が増大したことなどから、債券市場では金利低下(債券価格上昇)傾向が続きました。

9月以降は、10月末に日銀が追加金融緩和を実施し、その後日本政府が消費税率の再引き上げの延期を決定したことから外国為替市場では円安となり、基準価額は12月中旬にかけて大幅に上昇しました。

2015年1月以降は、スイス国立銀行による自国通貨の対ユーロでの上限撤廃が市場の混乱を招きリスク回避の動きが強まったことやECBの量的金融緩和を受けて、対米ドル以外で円が反発したことから、基準価額は小幅に低下しました。

投資環境



主要国の長期金利は、ウクライナや中東における地政学的リスクの高まりや原油価格下落により世界的にインフレ率が低下したこと、また、欧州においてはECB(欧州中央銀行)のマイナス金利導入を含む利下げと量的金融緩和の実施やギリシャ情勢の不透明感が増大したことなどから、期を通じて低下しました。

2014年10月末に日銀が追加金融緩和を実施したことから外国為替市場では大幅に円安が進行しましたが、2015年1月以降はスイス国立銀行による自国通貨の対ユーロでの上限撤廃が市場の混乱を招きリスク回避の動きが強まったことやECBの量的金融緩和実施を受けて、対米ドル以外では円が反発する動きを見せました。

当該投資信託のポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「外国債券マザーファンド」への投資を通じて、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

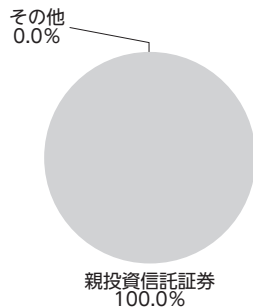
当該投資信託の組入資産の内容

○組入ファンド

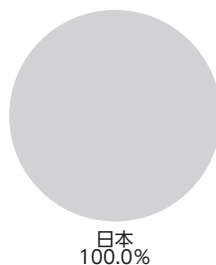
	第5期末
	2015年2月9日
外国債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

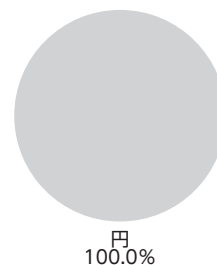
○資産別配分



○国別配分



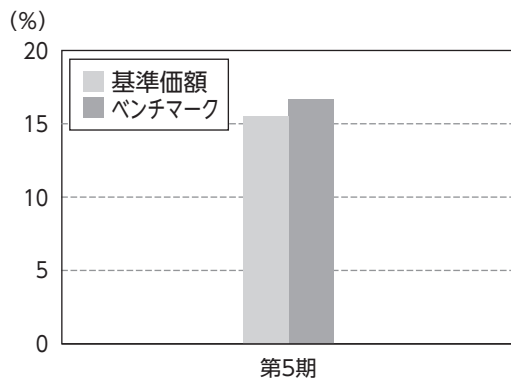
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当該投資信託のベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



基準価額騰落率はベンチマークの騰落率を下回りました。主な要因は、信託報酬および為替評価差要因*等です。

*ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

分配金

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきました。なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第5期	
	2014年2月8日～2015年2月9日	
当期分配金 (円)	20	
(対基準価額比率) (%)	(0.139)	
当期の収益 (円)	20	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	4,389	

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3) —印は該当がないことを示します。

■ 今後の運用方針

公社債への実質投資は、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2014年2月8日～2015年2月9日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	73円	0.543%	(a) 信託報酬 = $\frac{\text{期中の平均基準価額}}{\text{期中の平均基準価額}} \times \text{信託報酬率}$ 期中の平均基準価額は13,422円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 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、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(28)	(0.206)	
(販売会社)	(39)	(0.293)	
(受託会社)	(6)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	3	0.019	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、証拠金利息の調整金額等
(保管費用)	(2)	(0.013)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	76	0.564	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)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、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各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。

(注4) 一印は該当がないことを示します。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券マザーファンド	千口 532,660	千円 1,201,414	千口 86,210	千円 206,521

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

<外国債券マザーファンド>

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	149,829	149,829	100.0	152,055	152,055	100.0
為替直物取引	3,198	3,156	98.7	119,569	118,596	99.2

<平均保有割合 1.1%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券マザーファンド	千口 1,149,410	千口 1,595,860	千円 3,890,707

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、103,843,277千口です。

※ 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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券マザーファンド	3,890,707	99.6
コール・ローン等、その他	17,554	0.4
投資信託財産総額	3,908,261	100.0

(注1) 外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(247,741,916千円)の投資信託財産総額(253,856,632千円)に対する比率は97.6%です。

(注2) 外貨建資産は、当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。1米ドル=118.91円、1カナダドル=94.99円、1メキシコペソ=8.01円、1ユーロ=134.51円、1イギリスポンド=181.25円、1スイスフラン=128.54円、1スウェーデンクローナ=14.13円、1ノルウェークローネ=15.59円、1デンマーククローネ=18.07円、1ポーランドズロチ=32.39円、1オーストラリアドル=92.16円、1シンガポールドル=87.86円、1マレーシアリングギット=33.40円、1南アフリカランド=10.34円です。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2015年2月9日現在
(A) 資 産	3,908,261,288円
コール・ローン等	17,554,183
外国債券マザーファンド(評価額)	3,890,707,079
未 収 利 息	26
(B) 負 債	17,094,180
未 払 収 益 分 配 金	5,408,434
未 払 解 約 金	1,704,003
未 払 信 託 報 酬	9,882,969
そ の 他 未 払 費 用	98,774
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,891,167,108
元 本	2,704,217,300
次 期 繰 越 損 益 金	1,186,949,808
(D) 受 益 権 総 口 数	2,704,217,300口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,389円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2014年2月8日 至 2015年2月9日
(A) 配 当 等 収 益	4,949円
受 取 利 息	4,949
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	417,396,242
売 買 益	484,502,126
売 買 損	△67,105,884
(C) 信 託 報 酬 等	△17,330,794
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	400,070,397
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	197,139,475
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	595,148,370
(配 当 等 相 当 額)	(567,219,090)
(売 買 損 益 相 当 額)	(27,929,280)
(G) 計 (D+E+F)	1,192,358,242
(H) 収 益 分 配 金	△5,408,434
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	1,186,949,808
追 加 信 託 差 損 益 金	595,148,370
(配 当 等 相 当 額)	(568,581,210)
(売 買 損 益 相 当 額)	(26,567,160)
分 配 準 備 積 立 金	591,801,438

(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。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は1,934,187,366円、期中追加設定元本額は1,436,415,881円、期中一部解約元本額は666,385,947円です。

※1口当たり純資産額は、1.4389円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	85,954,342円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	314,116,055円
(C) 収益調整金額	595,148,370円
(D) 分配準備積立金額	197,139,475円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	1,192,358,242円
(F) 期末残存口数	2,704,217,300口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	4,409円
(H) 分配金額(1万口当たり)	20円
(I) 収益分配金額 (F×H/10,000)	5,408,434円

分配金のお知らせ

	当 期
1万口当たり分配金	20円

(注)分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

【分配金の課税上の取扱いについて】

- ・収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

- ・課税上の詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。
- ・税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

お知らせ

当ファンドのベンチマークの名称を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2014年5月8日)

運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2014年12月1日)

信託契約の解約、変更等における書面決議の要件を緩和するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2014年12月1日)

信託契約の解約、変更等における書面決議に反対の受益者による買取請求権に係る条項を削除するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。なお、反対の受益者は解約の実行の請求を選択することによって対応できます。

(変更日：2014年12月1日)

外国債券マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2015年2月9日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2001年2月22日から無期限です。
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資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。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・ 基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第10期(2011年2月7日)	14,691	△6.2	280,388	△6.7	97.2	0.9	419,677
第11期(2012年2月7日)	14,713	0.1	281,993	0.6	97.2	1.0	397,567
第12期(2013年2月7日)	18,891	28.4	362,920	28.7	98.2	0.4	456,807
第13期(2014年2月7日)	20,988	11.1	402,308	10.9	96.5	1.6	329,212
第14期(2015年2月9日)	24,380	16.2	469,338	16.7	96.8	1.6	253,174

(注)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2014年 2月 7日	20,988	—	402,308	—	96.5	1.6
2月末	21,247	1.2	407,861	1.4	97.3	0.9
3月末	21,552	2.7	413,385	2.8	97.2	1.0
4月末	21,662	3.2	415,471	3.3	97.6	0.7
5月末	21,571	2.8	413,818	2.9	97.9	0.6
6月末	21,659	3.2	415,582	3.3	96.5	1.6
7月末	21,866	4.2	419,355	4.2	96.9	1.2
8月末	22,219	5.9	426,420	6.0	97.6	0.9
9月末	22,853	8.9	438,138	8.9	98.1	0.4
10月末	22,896	9.1	438,300	8.9	97.0	1.3
11月末	24,836	18.3	475,708	18.2	97.0	1.4
12月末	25,104	19.6	482,546	19.9	96.5	1.4
2015年 1月末	24,349	16.0	467,265	16.1	96.5	1.6
(当期末) 2015年 2月 9日	24,380	16.2	469,338	16.7	96.8	1.6

(注1)騰落率は期首比です。

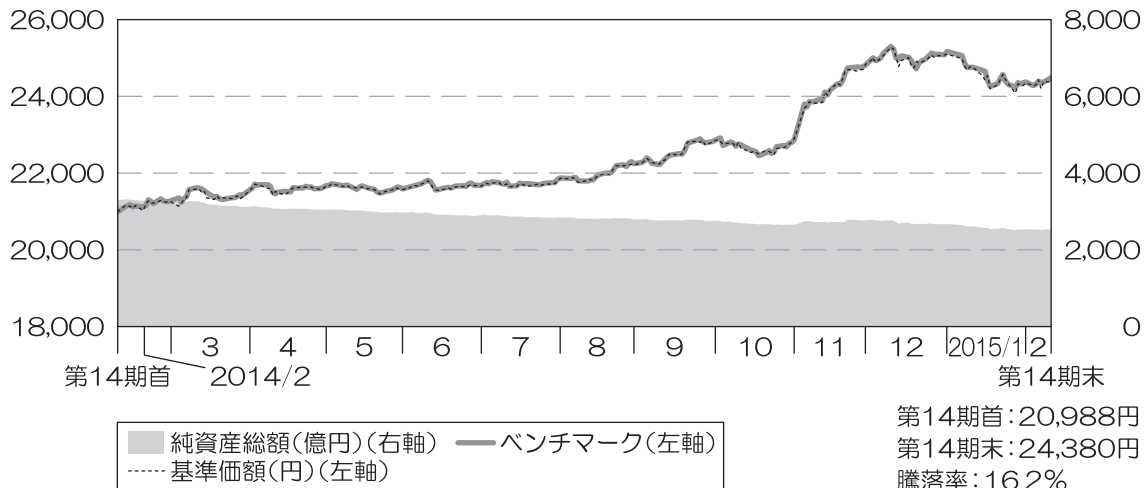
(注2)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

ベンチマークは、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)です。

シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは2014年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

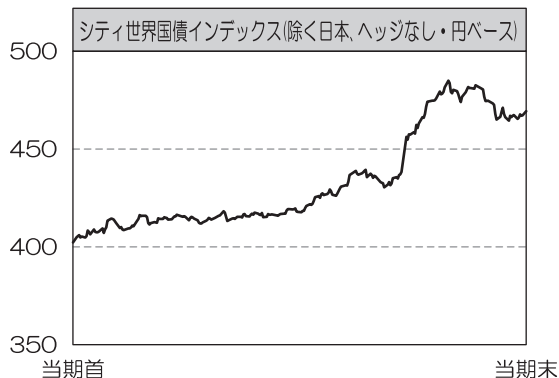
基準価額の主な変動要因

期初より2014年8月末まで、外国為替市場での安定的推移が続いた一方、債券市場ではECB(欧州中央銀行)の利下げ実施やウクライナや中東での地政学的リスクの高まりなどを背景にした債券需要により債券価格が上昇し、基準価額は緩やかに上昇しました。その後も原油価格下落を背景とした世界的な低インフレ傾向、ECBによる量的金融緩和の実施やギリシャ情勢の不透明感が増大したことなどから、債券市場では金利低下(債券価格上昇)傾向が続きました。

9月以降は、10月末に日銀が追加金融緩和を実施し、その後日本政府が消費税率の再引き上げの延期を決定したことから外国為替市場では円安となり、基準価額は12月中旬にかけて大幅に上昇しました。

2015年1月以降は、スイス国立銀行による自国通貨の対ユーロでの上限撤廃が市場の混乱を招きリスク回避の動きが強まったことやECBの量的金融緩和を受けて、対米ドル以外で円が反発したことから、基準価額は小幅に低下しました。

投資環境



主要国の長期金利は、ウクライナや中東における地政学的リスクの高まりや原油価格下落により世界的にインフレ率が低下したこと、また、欧州においてはECB(欧州中央銀行)のマイナス金利導入を含む利下げと量的金融緩和の実施やギリシャ情勢の不透明感が増大したことなどから、期を通じて低下しました。

外国為替市場では、2014年10月末に日銀が追加金融緩和を実施したことから大幅に円安が進行しましたが、2015年1月以降はスイス国立銀行による自国通貨の対ユーロでの上限撤廃が市場の混乱を招きリスク回避の動きが強まったことやECBの量的金融緩和実施を受けて、対米ドル以外では円が反発する動きを見せました。

当該投資信託のポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

当該投資信託の組入資産の内容

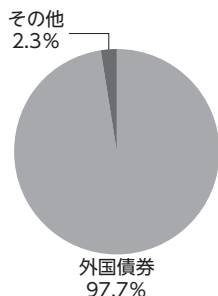
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	T 2.625% 11/15/20	アメリカ	0.6%
2	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	0.5%
3	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	0.5%
4	T 2.25% 03/31/16	アメリカ	0.4%
5	T 0.625% 08/15/16	アメリカ	0.4%
6	FRTR 5.75% 10/25/32	フランス	0.4%

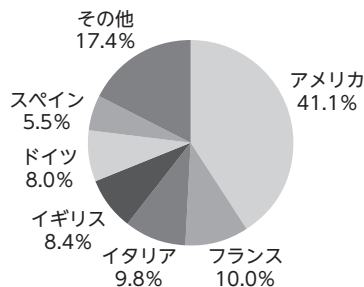
順位	銘柄名	国	組入比率
7	T 0.625% 10/15/16	アメリカ	0.4%
8	T 0.625% 12/15/16	アメリカ	0.4%
9	T 3.125% 08/15/44	アメリカ	0.4%
10	T 3.5% 05/15/20	アメリカ	0.4%
組入銘柄数			658

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

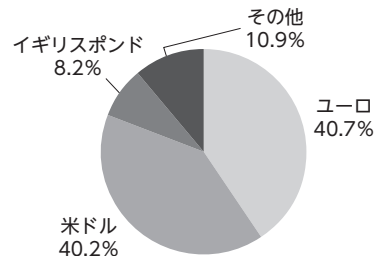
○資産別配分



○国別配分



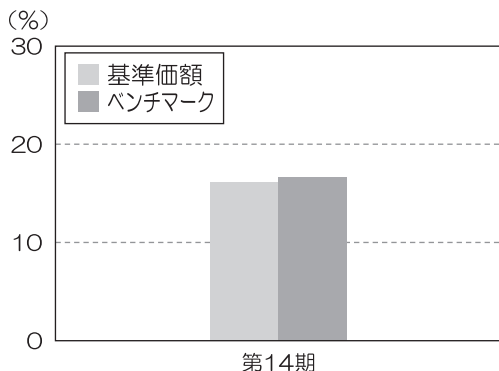
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当該投資信託のベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



基準価額騰落率はベンチマークの騰落率を下回りました。主な要因は、為替評価差要因*等です。

※ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

今後の運用方針

シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2014年2月8日～2015年2月9日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.002%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	3	0.013	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、証拠金利息の調整金額等
(保管費用)	(3)	(0.013)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	3	0.015	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)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。

(注2) 各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(22,651円)で除して100を乗じたものです。

(注4) -印は該当がないことを示します。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期		
		買 付 額	売 付 額	
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 192,564	千米ドル 584,398
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 10,178	千カナダドル 36,619
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 34,903	千メキシコペソ 138,872
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	15,447	86,222
	イ タ リ ア	国 債 証 券	22,958	104,331
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	21,476	94,711
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	4,887	24,444
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	13,001	54,454
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	2,886	25,486
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	1,201	14,499
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	1,422	6,073
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	1,505	7,803
	国	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 12,852
ス イ ス		国 債 証 券	千スイスフラン 1,005	千スイスフラン 4,667
ス ウ ェ ー デ ン		国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 8,412	千スウェーデンクローナ 49,145
ノ ル ウ ェ ー		国 債 証 券	千ノルウェークローネ 9,011	千ノルウェークローネ 32,464
デ ン マ ー ク		国 債 証 券	千デンマーククローネ 6,070	千デンマーククローネ 55,067
ポ ー ラ ン ド		国 債 証 券	千ポーランドズロチ 7,872	千ポーランドズロチ 50,713
オ ー ス ト ラ リ ア		国 債 証 券	千オーストラリアドル 6,979	千オーストラリアドル 19,536
シ ン ガ ポ ー ル		国 債 証 券	千シンガポールドル 3,094	千シンガポールドル 6,660
マ レ ー シ ア		国 債 証 券	千マレーシアリンギット 3,911	千マレーシアリンギット 20,935
南 ア フ リ カ		国 債 証 券	千南アフリカランド 12,938	千南アフリカランド 48,472

(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。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 89,000	百万円 90,472	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為 替 先 物 取 引	149,829	149,829	100.0	152,055	152,055	100.0
為 替 直 物 取 引	3,198	3,156	98.7	119,569	118,596	99.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち80%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	千米ドル 806,690	千米ドル 850,216	千円 101,099,222	% 39.9	% —	% 15.5	% 15.5	% 8.9
カ ナ ダ	千カナダドル 50,800	千カナダドル 58,387	5,546,211	2.2	—	1.1	0.6	0.6
メ キ シ コ	千メキシコペソ 289,450	千メキシコペソ 329,325	2,637,896	1.0	—	0.6	0.3	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	119,180	144,739	19,468,937	7.7	—	4.5	2.3	0.9
イ タ リ ア	145,150	178,570	24,019,467	9.5	—	6.0	2.5	0.9
フ ラ ン ス	145,400	180,159	24,233,277	9.6	—	5.8	2.7	1.1
オ ラ ン ダ	39,220	47,851	6,436,446	2.5	—	1.5	0.7	0.3
ス ペ イ ン	82,170	99,009	13,317,825	5.3	—	3.0	1.4	0.9
ベ ル ギ ー	37,790	48,226	6,486,950	2.6	—	1.7	0.6	0.2
オ ー ス ト リ ア	23,450	29,668	3,990,696	1.6	—	1.0	0.5	0.1
フ ィ ン ラ ン ド	9,950	11,577	1,557,318	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ア イ ル ラ ン ド	12,450	15,021	2,020,562	0.8	—	0.5	0.3	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 92,220	千イギリスポンド 113,043	20,489,046	8.1	—	6.1	1.5	0.4
ス イ ス	千スイスフラン 5,970	千スイスフラン 7,136	917,297	0.4	—	0.2	0.2	0.0
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 69,800	千スウェーデンクローナ 82,823	1,170,302	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 38,850	千ノルウェークローネ 43,697	681,244	0.3	—	0.2	0.1	—
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 75,550	千デンマーククローネ 101,340	1,831,224	0.7	—	0.5	0.2	0.1
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 39,300	千ポーランドズロチ 43,843	1,420,087	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 39,350	千オーストラリアドル 44,346	4,087,008	1.6	—	1.0	0.5	0.1
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 10,100	千シンガポールドル 10,755	944,997	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 37,440	千マレーシアリンギット 37,852	1,264,264	0.5	—	0.3	0.2	0.1
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド 131,500	千南アフリカランド 133,279	1,378,114	0.5	—	0.4	0.1	—
合 計	—	—	244,998,400	96.8	—	51.0	30.7	15.0

(注1) 邦貨換算金額は、当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、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千米ドル	外貨建金額	千米ドル	邦貨換算金額				千米ドル	外貨建金額	千米ドル	邦貨換算金額	
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円			%	千米ドル	千米ドル	千円			
国債証券													
T 0.25% 04/15/16	0.25	5,000	4,995	594,015	2016/4/15	T 1.125% 03/31/20	1.125	2,000	1,961	233,281	2020/3/31		
T 0.25% 05/15/16	0.25	5,000	4,992	593,702	2016/5/15	T 1.125% 05/31/19	1.125	4,800	4,748	564,670	2019/5/31		
T 0.375% 02/15/16	0.375	6,400	6,407	761,871	2016/2/15	T 1.125% 12/31/19	1.125	5,200	5,115	608,320	2019/12/31		
T 0.375% 03/15/16	0.375	1,150	1,150	136,842	2016/3/15	T 1.25% 01/31/19	1.25	4,800	4,785	569,062	2019/1/31		
T 0.5% 06/15/16	0.5	1,050	1,051	125,009	2016/6/15	T 1.25% 04/30/19	1.25	2,000	1,990	236,677	2019/4/30		
T 0.5% 07/31/17	0.5	7,010	6,948	826,281	2017/7/31	T 1.375% 02/28/19	1.375	5,500	5,508	655,052	2019/2/28		
T 0.5% 11/30/16	0.5	4,000	3,993	474,887	2016/11/30	T 1.375% 05/31/20	1.375	5,000	4,957	589,533	2020/5/31		
T 0.625% 02/15/17	0.625	5,000	4,995	594,015	2017/2/15	T 1.375% 06/30/18	1.375	3,500	3,522	418,899	2018/6/30		
T 0.625% 04/30/18	0.625	2,850	2,805	333,558	2018/4/30	T 1.375% 07/31/18	1.375	6,000	6,036	717,779	2018/7/31		
T 0.625% 05/31/17	0.625	3,000	2,989	355,489	2017/5/31	T 1.375% 09/30/18	1.375	2,520	2,531	301,075	2018/9/30		
T 0.625% 07/15/16	0.625	7,000	7,016	834,385	2016/7/15	T 1.375% 11/30/18	1.375	3,000	3,011	358,137	2018/11/30		
T 0.625% 08/15/16	0.625	9,050	9,068	1,078,279	2016/8/15	T 1.375% 12/31/18	1.375	3,700	3,708	441,032	2018/12/31		
T 0.625% 08/31/17	0.625	2,500	2,482	295,242	2017/8/31	T 1.5% 01/31/19	1.5	8,550	8,607	1,023,531	2019/1/31		
T 0.625% 09/30/17	0.625	3,250	3,223	383,317	2017/9/30	T 1.5% 02/28/19	1.5	6,100	6,140	730,224	2019/2/28		
T 0.625% 10/15/16	0.625	9,000	9,010	1,071,465	2016/10/15	T 1.5% 05/31/19	1.5	1,350	1,356	161,262	2019/5/31		
T 0.625% 11/15/16	0.625	8,500	8,506	1,011,504	2016/11/15	T 1.5% 06/30/16	1.5	7,450	7,558	898,838	2016/6/30		
T 0.625% 11/30/17	0.625	5,000	4,949	588,511	2017/11/30	T 1.5% 07/31/16	1.5	8,500	8,627	1,025,876	2016/7/31		
T 0.625% 12/15/16	0.625	9,000	9,003	1,070,628	2016/12/15	T 1.5% 08/31/18	1.5	6,500	6,562	780,357	2018/8/31		
T 0.75% 02/28/18	0.75	4,500	4,456	529,879	2018/2/28	T 1.5% 10/31/19	1.5	3,200	3,205	381,158	2019/10/31		
T 0.75% 03/31/18	0.75	1,000	989	117,616	2018/3/31	T 1.5% 11/30/19	1.5	5,000	5,007	595,386	2019/11/30		
T 0.75% 06/30/17	0.75	4,000	3,992	474,776	2017/6/30	T 1.5% 12/31/18	1.5	2,500	2,518	299,463	2018/12/31		
T 0.75% 10/31/17	0.75	1,600	1,591	189,189	2017/10/31	T 1.625% 03/31/19	1.625	4,400	4,448	528,946	2019/3/31		
T 0.75% 12/31/17	0.75	5,000	4,962	590,044	2017/12/31	T 1.625% 04/30/19	1.625	7,000	7,076	841,409	2019/4/30		
T 0.875% 01/31/17	0.875	2,000	2,008	238,874	2017/1/31	T 1.625% 06/30/19	1.625	4,000	4,038	480,266	2019/6/30		
T 0.875% 01/31/18	0.875	2,000	1,990	236,663	2018/1/31	T 1.625% 07/31/19	1.625	6,500	6,557	779,708	2019/7/31		
T 0.875% 02/28/17	0.875	6,000	6,023	716,260	2017/2/28	T 1.625% 08/15/22	1.625	5,700	5,629	669,460	2022/8/15		
T 0.875% 04/15/17	0.875	5,000	5,015	596,349	2017/4/15	T 1.625% 11/15/22	1.625	4,000	3,942	468,774	2022/11/15		
T 0.875% 04/30/17	0.875	3,350	3,359	399,429	2017/4/30	T 1.75% 05/15/22	1.75	4,600	4,588	545,597	2022/5/15		
T 0.875% 05/15/17	0.875	6,000	6,014	715,215	2017/5/15	T 1.75% 05/15/23	1.75	7,950	7,873	936,250	2023/5/15		
T 0.875% 06/15/17	0.875	4,550	4,557	541,885	2017/6/15	T 1.75% 05/31/16	1.75	4,600	4,681	556,729	2016/5/31		
T 0.875% 07/15/17	0.875	4,000	4,003	476,113	2017/7/15	T 1.75% 10/31/18	1.75	1,800	1,832	217,858	2018/10/31		
T 0.875% 07/31/19	0.875	5,000	4,883	580,673	2019/7/31	T 1.875% 06/30/20	1.875	5,200	5,288	628,887	2020/6/30		
T 0.875% 09/15/16	0.875	5,000	5,028	597,882	2016/9/15	T 1.875% 08/31/17	1.875	2,000	2,049	243,709	2017/8/31		
T 0.875% 11/30/16	0.875	2,000	2,009	239,004	2016/11/30	T 1.875% 09/30/17	1.875	1,210	1,239	147,424	2017/9/30		
T 0.875% 12/31/16	0.875	5,000	5,023	597,325	2016/12/31	T 1.875% 10/31/17	1.875	4,900	5,020	597,032	2017/10/31		
T 1% 03/31/17	1.0	5,000	5,029	598,045	2017/3/31	T 1.875% 11/30/21	1.875	3,500	3,523	419,030	2021/11/30		
T 1% 05/31/18	1.0	1,000	995	118,317	2018/5/31	T 2% 01/31/16	2.0	3,000	3,050	362,714	2016/1/31		
T 1% 06/30/19	1.0	1,200	1,179	140,295	2019/6/30	T 2% 02/15/22	2.0	3,100	3,149	374,459	2022/2/15		
T 1% 08/31/16	1.0	4,850	4,887	581,174	2016/8/31	T 2% 02/15/23	2.0	6,500	6,575	781,836	2023/2/15		
T 1% 08/31/19	1.0	2,800	2,746	326,601	2019/8/31	T 2% 02/28/21	2.0	1,550	1,577	187,586	2021/2/28		
T 1% 09/15/17	1.0	7,000	7,015	834,174	2017/9/15	T 2% 04/30/16	2.0	6,090	6,211	738,616	2016/4/30		
T 1% 09/30/16	1.0	3,000	3,023	359,503	2016/9/30	T 2% 05/31/21	2.0	3,000	3,049	362,638	2021/5/31		
T 1% 09/30/19	1.0	5,000	4,901	582,868	2019/9/30	T 2% 07/31/20	2.0	4,000	4,090	486,379	2020/7/31		
T 1% 10/31/16	1.0	6,200	6,246	742,828	2016/10/31	T 2% 08/31/21	2.0	4,200	4,264	507,147	2021/8/31		
T 1% 11/30/19	1.0	6,100	5,967	709,611	2019/11/30	T 2% 11/15/21	2.0	4,300	4,367	519,352	2021/11/15		
T 1% 12/15/17	1.0	6,000	6,002	713,724	2017/12/15	T 2% 11/30/20	2.0	6,000	6,116	727,352	2020/11/30		

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千米ドル	千米ドル	外貨建金額	邦貨換算金額				千米ドル	千米ドル	外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	千円		%	千米ドル	千米ドル	千円	千円		
T 2.125% 01/31/21	2.125	5,000	5,128	609,773	2021/1/31	T 3.125% 05/15/21	3.125	4,190	4,542	540,154	2021/5/15		
T 2.125% 06/30/21	2.125	3,000	3,070	365,160	2021/6/30	T 3.125% 08/15/44	3.125	7,700	8,666	1,030,504	2044/8/15		
T 2.125% 08/15/21	2.125	2,900	2,969	353,069	2021/8/15	T 3.125% 10/31/16	3.125	1,400	1,461	173,770	2016/10/31		
T 2.125% 08/31/20	2.125	6,000	6,169	733,609	2020/8/31	T 3.125% 11/15/41	3.125	3,200	3,600	428,083	2041/11/15		
T 2.25% 03/31/16	2.25	9,150	9,350	1,111,827	2016/3/31	T 3.25% 03/31/17	3.25	5,000	5,269	626,588	2017/3/31		
T 2.25% 03/31/21	2.25	3,000	3,096	368,226	2021/3/31	T 3.25% 05/31/16	3.25	3,250	3,371	400,896	2016/5/31		
T 2.25% 04/30/21	2.25	4,700	4,849	576,702	2021/4/30	T 3.25% 06/30/16	3.25	2,500	2,597	308,852	2016/6/30		
T 2.25% 07/31/18	2.25	4,500	4,660	554,220	2018/7/31	T 3.25% 07/31/16	3.25	3,560	3,705	440,649	2016/7/31		
T 2.25% 07/31/21	2.25	4,500	4,642	552,046	2021/7/31	T 3.25% 12/31/16	3.25	2,800	2,937	349,348	2016/12/31		
T 2.25% 11/15/24	2.25	5,000	5,132	610,296	2024/11/15	T 3.375% 05/15/44	3.375	1,500	1,765	209,888	2044/5/15		
T 2.25% 11/30/17	2.25	2,000	2,069	246,111	2017/11/30	T 3.375% 11/15/19	3.375	5,900	6,424	763,942	2019/11/15		
T 2.375% 03/31/16	2.375	7,900	8,083	961,240	2016/3/31	T 3.5% 02/15/18	3.5	3,650	3,912	465,225	2018/2/15		
T 2.375% 05/31/18	2.375	3,800	3,949	469,649	2018/5/31	T 3.5% 02/15/39	3.5	1,600	1,902	226,233	2039/2/15		
T 2.375% 06/30/18	2.375	2,500	2,598	308,968	2018/6/30	T 3.5% 05/15/20	3.5	7,900	8,687	1,032,979	2020/5/15		
T 2.375% 07/31/17	2.375	2,000	2,074	246,687	2017/7/31	T 3.625% 02/15/20	3.625	9,800	10,820	1,286,606	2020/2/15		
T 2.375% 08/15/24	2.375	6,700	6,949	826,370	2024/8/15	T 3.625% 02/15/21	3.625	5,230	5,815	691,486	2021/2/15		
T 2.375% 12/31/20	2.375	7,200	7,491	890,799	2020/12/31	T 3.625% 02/15/44	3.625	6,500	7,983	949,326	2044/2/15		
T 2.5% 05/15/24	2.5	5,800	6,078	722,760	2024/5/15	T 3.625% 08/15/19	3.625	5,500	6,031	717,233	2019/8/15		
T 2.5% 06/30/17	2.5	3,200	3,328	395,829	2017/6/30	T 3.625% 08/15/43	3.625	3,200	3,929	467,271	2043/8/15		
T 2.5% 08/15/23	2.5	7,000	7,342	873,078	2023/8/15	T 3.75% 08/15/41	3.75	4,800	6,010	714,753	2041/8/15		
T 2.625% 01/31/18	2.625	4,300	4,497	534,781	2018/1/31	T 3.75% 11/15/18	3.75	5,040	5,501	654,238	2018/11/15		
T 2.625% 02/29/16	2.625	2,850	2,919	347,206	2016/2/29	T 3.75% 11/15/43	3.75	1,400	1,756	208,879	2043/11/15		
T 2.625% 04/30/16	2.625	5,100	5,241	623,236	2016/4/30	T 3.875% 05/15/18	3.875	1,150	1,251	148,837	2018/5/15		
T 2.625% 04/30/18	2.625	3,600	3,772	448,543	2018/4/30	T 3.875% 08/15/40	3.875	4,910	6,213	738,818	2040/8/15		
T 2.625% 08/15/20	2.625	5,000	5,273	627,029	2020/8/15	T 4.0% 08/15/18	4.0	4,000	4,391	522,172	2018/8/15		
T 2.625% 11/15/20	2.625	13,000	13,701	1,629,220	2020/11/15	T 4.25% 05/15/39	4.25	1,750	2,324	276,417	2039/5/15		
T 2.75% 02/15/19	2.75	2,000	2,113	251,271	2019/2/15	T 4.25% 11/15/17	4.25	1,350	1,470	174,860	2017/11/15		
T 2.75% 02/15/24	2.75	9,000	9,626	1,144,706	2024/2/15	T 4.25% 11/15/40	4.25	3,600	4,824	573,705	2040/11/15		
T 2.75% 02/28/18	2.75	290	304	36,200	2018/2/28	T 4.375% 02/15/38	4.375	700	941	111,950	2038/2/15		
T 2.75% 05/31/17	2.75	4,900	5,121	609,026	2017/5/31	T 4.375% 05/15/40	4.375	4,750	6,453	767,342	2040/5/15		
T 2.75% 08/15/42	2.75	3,150	3,293	391,634	2042/8/15	T 4.375% 05/15/41	4.375	3,350	4,603	547,347	2041/5/15		
T 2.75% 11/15/23	2.75	7,950	8,502	1,010,990	2023/11/15	T 4.375% 11/15/39	4.375	3,100	4,197	499,121	2039/11/15		
T 2.75% 11/15/42	2.75	2,900	3,029	360,195	2042/11/15	T 4.5% 02/15/16	4.5	2,420	2,523	300,059	2016/2/15		
T 2.75% 11/30/16	2.75	3,000	3,115	370,483	2016/11/30	T 4.5% 02/15/36	4.5	1,400	1,920	228,342	2036/2/15		
T 2.75% 12/31/17	2.75	5,300	5,561	661,340	2017/12/31	T 4.5% 05/15/17	4.5	3,500	3,792	450,975	2017/5/15		
T 2.875% 03/31/18	2.875	4,800	5,060	601,725	2018/3/31	T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,368	162,725	2038/5/15		
T 2.875% 05/15/43	2.875	7,300	7,812	929,026	2043/5/15	T 4.5% 08/15/39	4.5	1,250	1,719	204,515	2039/8/15		
T 3% 02/28/17	3.0	4,600	4,817	572,903	2017/2/28	T 4.625% 02/15/17	4.625	5,500	5,935	705,814	2017/2/15		
T 3% 05/15/42	3.0	3,400	3,731	443,712	2042/5/15	T 4.625% 02/15/40	4.625	1,500	2,104	250,282	2040/2/15		
T 3% 08/31/16	3.0	1,030	1,069	127,208	2016/8/31	T 4.625% 11/15/16	4.625	2,450	2,624	312,029	2016/11/15		
T 3% 09/30/16	3.0	4,000	4,161	494,786	2016/9/30	T 4.75% 02/15/41	4.75	2,300	3,325	395,405	2041/2/15		
T 3% 11/15/44	3.0	2,050	2,255	268,194	2044/11/15	T 4.75% 08/15/17	4.75	3,000	3,290	391,267	2017/8/15		
T 3.125% 01/31/17	3.125	4,000	4,194	498,715	2017/1/31	T 4.875% 08/15/16	4.875	750	799	95,111	2016/8/15		
T 3.125% 02/15/42	3.125	3,800	4,270	507,775	2042/2/15	T 5.0% 05/15/37	5.0	1,150	1,685	200,400	2037/5/15		
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,600	2,915	346,664	2043/2/15	T 5.125% 05/15/16	5.125	2,000	2,120	252,093	2016/5/15		
T 3.125% 04/30/17	3.125	4,900	5,157	613,271	2017/4/30	T 5.25% 02/15/29	5.25	1,000	1,370	162,936	2029/2/15		
T 3.125% 05/15/19	3.125	3,620	3,882	461,687	2019/5/15	T 5.25% 11/15/28	5.25	1,350	1,845	219,434	2028/11/15		

当 期 末					当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日		
		外貨建金額	邦貨換算金額				外貨建金額	邦貨換算金額			
	%	千米ドル	千米ドル	千円		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,900	2,701	321,291	2031/2/15	(メキシコ) 国債証券					
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,250	1,740	207,003	2028/8/15	MBONO 10% 11/20/36	10.0	9,450	13,767	110,275	2036/11/20
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,350	1,884	224,043	2026/2/15	MBONO 10% 12/05/24	10.0	21,500	28,607	229,145	2024/12/5
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,300	1,883	223,912	2027/11/15	MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	25,400	25,521	204,424	2018/6/14
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,500	2,281	271,341	2030/5/15	MBONO 5% 06/15/17	5.0	17,950	18,414	147,501	2017/6/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	3,600	4,853	577,099	2023/8/15	MBONO 5% 12/11/19	5.0	3,050	3,046	24,404	2019/12/11
T 6.5% 11/15/26	6.5	450	659	78,437	2026/11/15	MBONO 6.25% 06/16/16	6.25	21,700	22,490	180,150	2016/6/16
T 7.25% 05/15/16	7.25	1,670	1,814	215,773	2016/5/15	MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	15,850	16,864	135,080	2022/6/9
T 7.5% 11/15/16	7.5	3,250	3,645	433,443	2016/11/15	MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	17,700	18,819	150,742	2021/6/10
T 8.0% 11/15/21	8.0	2,600	3,645	433,430	2021/11/15	MBONO 7.25% 12/15/16	7.25	18,300	19,472	155,978	2016/12/15
T 8.75% 05/15/17	8.75	2,700	3,184	378,709	2017/5/15	MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	15,150	17,315	138,701	2027/6/3
T 8.75% 08/15/20	8.75	1,800	2,487	295,748	2020/8/15	MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	21,000	24,705	197,894	2031/5/29
小 計				101,099,222		MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	15,750	18,907	151,447	2042/11/13
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル			MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	1,900	2,254	18,061	2034/11/23
CAN 1% 05/01/16	1.0	2,700	2,715	257,990	2016/5/1	MBONO 7.75% 12/14/17	7.75	22,200	24,264	194,356	2017/12/14
CAN 1% 08/01/16	1.0	1,050	1,057	100,479	2016/8/1	MBONO 8% 06/11/20	8.0	11,600	13,154	105,370	2020/6/11
CAN 1% 11/01/16	1.0	550	554	52,716	2016/11/1	MBONO 8% 12/07/23	8.0	12,350	14,413	115,456	2023/12/7
CAN 1.25% 02/01/16	1.25	1,300	1,309	124,366	2016/2/1	MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	11,900	14,789	118,464	2029/5/31
CAN 1.25% 02/01/18	1.25	700	714	67,902	2018/2/1	MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	15,250	19,577	156,817	2038/11/18
CAN 1.25% 03/01/18	1.25	1,700	1,736	164,941	2018/3/1	MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	11,450	12,936	103,622	2018/12/13
CAN 1.25% 08/01/17	1.25	400	407	38,709	2017/8/1	小 計				2,637,896	
CAN 1.25% 09/01/18	1.25	1,050	1,073	101,968	2018/9/1	(ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
CAN 1.5% 02/01/17	1.5	1,300	1,325	125,938	2017/2/1	BKO 0% 12/16/16	-	400	401	54,012	2016/12/16
CAN 1.5% 03/01/17	1.5	600	612	58,217	2017/3/1	DBR 1% 08/15/24	1.0	1,800	1,911	257,171	2024/8/15
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	2,100	2,147	203,981	2023/6/1	DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,850	3,153	424,128	2023/2/15
CAN 1.5% 09/01/17	1.5	1,400	1,435	136,401	2017/9/1	DBR 1.5% 05/15/23	1.5	4,050	4,486	603,439	2023/5/15
CAN 1.75% 03/01/19	1.75	1,150	1,198	113,887	2019/3/1	DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,750	3,048	410,011	2024/5/15
CAN 1.75% 09/01/19	1.75	700	730	69,428	2019/9/1	DBR 1.5% 09/04/22	1.5	2,550	2,813	378,427	2022/9/4
CAN 2% 06/01/16	2.0	1,900	1,937	184,002	2016/6/1	DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,800	2,036	273,866	2024/2/15
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	900	970	92,151	2025/6/1	DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,800	3,141	422,497	2022/7/4
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,950	2,152	204,436	2024/6/1	DBR 2% 01/04/22	2.0	3,750	4,249	571,665	2022/1/4
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	1,950	2,177	206,826	2022/6/1	DBR 2% 08/15/23	2.0	1,800	2,071	278,610	2023/8/15
CAN 2.75% 09/01/16	2.75	3,150	3,259	309,629	2016/9/1	DBR 2.25% 09/04/20	2.25	2,150	2,427	326,528	2020/9/4
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	400	470	44,671	2048/12/1	DBR 2.25% 09/04/21	2.25	1,950	2,235	300,670	2021/9/4
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	500	616	58,539	2064/12/1	DBR 2.5% 01/04/21	2.5	2,650	3,044	409,541	2021/1/4
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,550	1,769	168,071	2021/6/1	DBR 2.5% 07/04/44	2.5	2,300	3,241	435,552	2044/7/4
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	2,400	2,729	259,307	2020/6/1	DBR 2.5% 08/15/46	2.5	700	992	133,562	2046/8/15
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	2,300	3,078	292,456	2045/12/1	DBR 3% 07/04/20	3.0	3,920	4,568	614,570	2020/7/4
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	3,650	4,123	391,683	2019/6/1	DBR 3.25% 01/04/20	3.25	2,050	2,389	321,360	2020/1/4
CAN 4% 06/01/16	4.0	2,550	2,666	253,257	2016/6/1	DBR 3.25% 07/04/21	3.25	2,450	2,957	397,871	2021/7/4
CAN 4% 06/01/17	4.0	1,750	1,892	179,762	2017/6/1	DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,050	3,226	433,937	2042/7/4
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	2,250	3,162	300,447	2041/6/1	DBR 3.5% 07/04/19	3.5	4,810	5,585	751,359	2019/7/4
CAN 4.25% 06/01/18	4.25	1,100	1,233	117,129	2018/6/1	DBR 3.75% 01/04/17	3.75	1,000	1,075	144,639	2017/1/4
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,600	2,479	235,523	2037/6/1	DBR 3.75% 01/04/19	3.75	5,300	6,114	822,404	2019/1/4
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,800	2,720	258,424	2029/6/1	DBR 4% 07/04/16	4.0	3,550	3,758	505,490	2016/7/4
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,750	2,804	266,399	2033/6/1	DBR 4.0% 01/04/18	4.0	2,550	2,861	384,899	2018/1/4
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	650	1,121	106,560	2027/6/1	DBR 4.0% 01/04/37	4.0	3,200	5,240	704,961	2037/1/4
小 計				5,546,211							

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額	
DBR 4.25% 07/04/17	4.25	2,750	3,044	409,458	2017/7/4	BTPS 4.5% 02/01/20	4.5	2,600	3,065	412,386	2020/2/1		
DBR 4.25% 07/04/18	4.25	2,300	2,648	356,246	2018/7/4	BTPS 4.5% 03/01/19	4.5	4,650	5,370	722,394	2019/3/1		
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,850	3,225	433,856	2039/7/4	BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,900	3,636	489,149	2024/3/1		
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,850	2,859	384,664	2028/7/4	BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,700	3,453	464,577	2026/3/1		
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,700	4,633	625,935	2034/7/4	BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	950	1,177	158,361	2023/5/1		
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,300	4,333	582,891	2040/7/4	BTPS 4.5% 08/01/18	4.5	4,950	5,622	756,313	2018/8/1		
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,250	3,898	524,445	2031/1/4	BTPS 4.75% 05/01/17	4.75	2,160	2,368	318,603	2017/5/1		
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,800	2,954	397,355	2028/1/4	BTPS 4.75% 06/01/17	4.75	4,700	5,170	695,514	2017/6/1		
DBR 6% 06/20/16	6.0	900	975	131,239	2016/6/20	BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	3,850	4,867	654,773	2023/8/1		
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,600	2,455	330,258	2024/1/4	BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	3,550	4,351	585,279	2021/9/1		
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	2,266	304,838	2030/1/4	BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,600	3,444	463,257	2028/9/1		
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,600	2,766	372,111	2027/7/4	BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,000	2,896	389,662	2044/9/1		
OBL 0.25% 04/13/18	0.25	3,050	3,092	415,921	2018/4/13	BTPS 4.75% 09/15/16	4.75	3,400	3,641	489,839	2016/9/15		
OBL 0.5% 02/23/18	0.5	3,950	3,114	418,879	2018/2/23	BTPS 5% 03/01/22	5.0	3,900	4,890	657,826	2022/3/1		
OBL 0.5% 04/07/17	0.5	3,050	4,010	539,387	2017/4/7	BTPS 5% 03/01/25	5.0	4,100	5,391	725,196	2025/3/1		
OBL 0.5% 04/12/19	0.5	450	462	62,194	2019/4/12	BTPS 5% 08/01/34	5.0	3,150	4,440	597,233	2034/8/1		
OBL 0.5% 10/13/17	0.5	2,800	2,852	383,708	2017/10/13	BTPS 5% 09/01/40	5.0	3,100	4,514	607,301	2040/9/1		
OBL 0.75% 02/24/17	0.75	2,900	2,956	397,644	2017/2/24	BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,350	3,411	458,133	2039/8/1		
OBL 1% 02/22/19	1.0	1,500	1,571	211,365	2019/2/22	BTPS 5.25% 08/01/17	5.25	1,750	1,959	263,543	2017/8/1		
OBL 1% 10/12/18	1.0	2,750	2,869	386,032	2018/10/12	BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,950	5,541	745,452	2029/11/1		
OBL 1.25% 10/14/16	1.25	2,200	2,253	303,178	2016/10/14	BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	3,200	4,161	559,710	2022/9/1		
OBL 2% 02/26/16	2.0	3,150	3,221	433,375	2016/2/26	BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	3,350	4,367	587,467	2022/11/1		
OBL 2.75% 04/08/16	2.75	5,050	5,221	702,364	2016/4/8	BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,400	3,634	488,852	2033/2/1		
(イタリア)						(フランス)							
国債証券						国債証券							
BTPS 1.5% 08/01/19	1.5	850	878	118,190	2019/8/1	BTPS 6% 05/01/31	6.0	4,150	6,337	852,418	2031/5/1		
BTPS 1.5% 12/15/16	1.5	100	102	13,749	2016/12/15	BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,850	4,320	581,160	2027/11/1		
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	700	743	100,030	2021/12/15	BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,550	2,445	328,994	2026/11/1		
BTPS 2.25% 05/15/16	2.25	750	769	103,438	2016/5/15	BTPS 9% 11/01/23	9.0	2,700	4,361	586,627	2023/11/1		
BTPS 2.5% 05/01/19	2.5	1,000	1,074	144,594	2019/5/1	(フランス)							
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	800	904	121,676	2046/9/1	国債証券							
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	1,300	1,539	207,072	2030/3/1	BTNS 1% 07/25/17	1.0	2,800	2,876	386,891	2017/7/25		
BTPS 3.5% 06/01/18	3.5	1,050	1,152	155,068	2018/6/1	BTNS 1.75% 02/25/17	1.75	3,150	3,270	439,853	2017/2/25		
BTPS 3.5% 11/01/17	3.5	2,900	3,141	422,506	2017/11/1	BTNS 2.25% 02/25/16	2.25	4,690	4,806	646,467	2016/2/25		
BTPS 3.5% 12/01/18	3.5	1,600	1,775	238,855	2018/12/1	BTNS 2.5% 07/25/16	2.5	3,800	3,944	530,561	2016/7/25		
BTPS 3.75% 03/01/21	3.75	4,240	4,910	660,470	2021/3/1	FRTR 0.5% 11/25/19	0.5	1,500	1,532	206,172	2019/11/25		
BTPS 3.75% 04/15/16	3.75	2,500	2,604	350,304	2016/4/15	FRTR 1% 05/25/18	1.0	2,400	2,484	334,145	2018/5/25		
BTPS 3.75% 05/01/21	3.75	1,000	1,158	155,817	2021/5/1	FRTR 1% 05/25/19	1.0	3,100	3,232	434,796	2019/5/25		
BTPS 3.75% 08/01/16	3.75	4,350	4,573	615,240	2016/8/1	FRTR 1% 11/25/18	1.0	2,900	3,013	405,366	2018/11/25		
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	4,800	5,577	750,230	2021/8/1	FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	2,500	2,766	372,056	2023/5/25		
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,750	3,284	441,837	2024/9/1	FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	3,150	3,491	469,574	2024/11/25		
BTPS 4% 02/01/17	4.0	5,650	6,059	815,038	2017/2/1	FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,300	4,959	667,118	2024/5/25		
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,750	4,708	633,370	2037/2/1	FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	4,050	4,625	622,184	2022/10/25		
BTPS 4% 09/01/20	4.0	3,850	4,489	603,888	2020/9/1	FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	1,850	2,243	301,773	2030/5/25		
BTPS 4.25% 02/01/19	4.25	5,950	6,797	914,322	2019/2/1	FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	3,600	4,086	549,728	2020/10/25		
BTPS 4.25% 03/01/20	4.25	4,200	4,908	660,185	2020/3/1	FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,850	5,954	800,918	2027/10/25		
BTPS 4.25% 09/01/19	4.25	3,150	3,645	490,383	2019/9/1	FRTR 3% 04/25/22	3.0	4,650	5,538	745,039	2022/4/25		
BTPS 4.5% 02/01/18	4.5	4,400	4,925	662,483	2018/2/1	FRTR 3.25% 04/25/16	3.25	5,400	5,619	755,862	2016/4/25		
						FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	1,500	2,188	294,314	2045/5/25		
						FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	5,550	6,657	895,523	2021/10/25		

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額	
FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	5,950	7,008	942,730	2020/4/25	SPGB 2.1% 04/30/17	2.1	2,300	2,388	321,328	2017/4/30		
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	3,000	3,888	523,089	2026/4/25	SPGB 2.75% 04/30/19	2.75	2,700	2,933	394,524	2019/4/30		
FRTR 3.75% 04/25/17	3.75	4,400	4,775	642,343	2017/4/25	SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	2,700	3,007	404,517	2024/10/31		
FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	4,700	5,733	771,226	2021/4/25	SPGB 3.15% 01/31/16	3.15	3,150	3,242	436,131	2016/1/31		
FRTR 3.75% 10/25/19	3.75	5,350	6,288	845,919	2019/10/25	SPGB 3.25% 04/30/16	3.25	1,750	1,815	244,223	2016/4/30		
FRTR 4% 04/25/18	4.0	5,000	5,653	760,485	2018/4/25	SPGB 3.3% 07/30/16	3.3	2,300	2,404	323,424	2016/7/30		
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,100	3,725	501,073	2055/4/25	SPGB 3.75% 10/31/18	3.75	1,750	1,953	262,722	2018/10/31		
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,500	2,723	366,322	2060/4/25	SPGB 3.8% 01/31/17	3.8	4,440	4,745	638,307	2017/1/31		
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,100	4,831	649,917	2038/10/25	SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	3,700	4,449	598,461	2024/4/30		
FRTR 4.25% 04/25/19	4.25	4,600	5,426	729,854	2019/4/25	SPGB 4% 04/30/20	4.0	3,350	3,884	522,523	2020/4/30		
FRTR 4.25% 10/25/17	4.25	4,550	5,087	684,254	2017/10/25	SPGB 4.1% 07/30/18	4.1	4,200	4,710	633,579	2018/7/30		
FRTR 4.25% 10/25/18	4.25	4,000	4,637	623,795	2018/10/25	SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,400	3,189	429,031	2037/1/31		
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,000	6,610	889,178	2023/10/25	SPGB 4.25% 10/31/16	4.25	4,050	4,330	582,436	2016/10/31		
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,350	5,730	770,815	2041/4/25	SPGB 4.3% 10/31/19	4.3	2,400	2,793	375,718	2019/10/31		
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,200	5,264	708,179	2035/4/25	SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	2,750	3,430	461,371	2023/10/31		
FRTR 5% 10/25/16	5.0	5,410	5,882	791,318	2016/10/25	SPGB 4.5% 01/31/18	4.5	2,450	2,740	368,596	2018/1/31		
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	4,550	7,338	987,054	2029/4/25	SPGB 4.6% 07/30/19	4.6	3,300	3,863	519,738	2019/7/30		
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,500	7,912	1,064,365	2032/10/25	SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,650	3,434	461,930	2025/7/30		
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	2,250	3,486	468,965	2025/10/25	SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,650	2,385	320,831	2041/7/30		
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,800	2,973	399,965	2023/4/25	SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	1,400	1,797	241,817	2024/1/31		
FRTR 8.5% 10/25/19	8.5	1,350	1,888	254,051	2019/10/25	SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	2,850	3,466	466,313	2020/10/31		
(オランダ)						SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,800	2,664	358,406	2040/7/30		
国債証券						SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	950	1,316	177,400	2028/10/31		
NETHER 0% 04/15/16	—	1,400	1,402	188,676	2016/4/15	SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	950	1,476	198,572	2044/10/31		
NETHER 0.5% 04/15/17	0.5	1,850	1,876	252,357	2017/4/15	SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,550	3,338	449,104	2023/1/31		
NETHER 1.25% 01/15/18	1.25	1,900	1,976	265,904	2018/1/15	SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	2,800	3,552	477,850	2021/4/30		
NETHER 1.25% 01/15/19	1.25	1,700	1,788	240,564	2019/1/15	SPGB 5.5% 07/30/17	5.5	2,750	3,094	416,256	2017/7/30		
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	2,300	2,569	345,612	2023/7/15	SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,400	3,683	495,450	2032/7/30		
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,600	1,831	246,351	2024/7/15	SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	2,960	3,892	523,526	2022/1/31		
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	1,400	1,607	216,272	2022/7/15	SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,500	2,222	298,890	2026/7/30		
NETHER 2.5% 01/15/17	2.5	2,050	2,154	289,827	2017/1/15	SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	3,120	4,667	627,880	2029/1/31		
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,350	1,747	234,990	2033/1/15	(ベルギー)							
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	500	740	99,590	2047/1/15	国債証券							
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	2,700	3,240	435,888	2021/7/15	BGB 0.8% 06/22/25	0.8	250	253	34,038	2025/6/22		
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	2,150	2,554	343,660	2020/7/15	BGB 1.25% 06/22/18	1.25	1,800	1,879	252,751	2018/6/22		
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	1,920	2,442	328,588	2023/1/15	BGB 2.25% 06/22/23	2.25	2,300	2,638	354,968	2023/6/22		
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,350	3,967	533,669	2042/1/15	BGB 2.6% 06/22/24	2.6	1,350	1,599	215,082	2024/6/22		
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,850	3,029	407,552	2037/1/15	BGB 2.75% 03/28/16	2.75	690	712	95,828	2016/3/28		
NETHER 4% 07/15/16	4.0	2,650	2,807	377,630	2016/7/15	BGB 3% 06/22/34	3.0	850	1,124	151,250	2034/6/22		
NETHER 4% 07/15/19	4.0	2,300	2,712	364,899	2019/7/15	BGB 3% 09/28/19	3.0	1,450	1,650	221,989	2019/9/28		
NETHER 4.0% 07/15/18	4.0	2,450	2,795	375,987	2018/7/15	BGB 3.25% 09/28/16	3.25	2,800	2,954	397,432	2016/9/28		
NETHER 4.5% 07/15/17	4.5	2,200	2,448	329,346	2017/7/15	BGB 3.5% 06/28/17	3.5	1,650	1,791	241,000	2017/6/28		
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,900	3,059	411,468	2028/1/15	BGB 3.75% 06/22/45	3.75	850	1,348	181,435	2045/6/22		
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	700	1,097	147,608	2023/1/15	BGB 3.75% 09/28/20	3.75	2,500	3,017	405,894	2020/9/28		
(スペイン)						BGB 4% 03/28/18	4.0	1,300	1,465	197,154	2018/3/28		
国債証券						BGB 4% 03/28/22	4.0	2,100	2,655	357,243	2022/3/28		
SPGB 1.4% 01/31/20	1.4	1,050	1,079	145,214	2020/1/31	BGB 4% 03/28/32	4.0	1,200	1,754	236,026	2032/3/28		
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,050	1,056	142,099	2025/4/30	BGB 4.0% 03/28/17	4.0	1,600	1,740	234,061	2017/3/28		

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千円	外貨建金額	邦貨換算金額	
BGB 4.0% 03/28/19	4.0	1,800	2,098	282,303	2019/3/28	IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	1,100	1,327	178,519	2024/3/18		
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,900	3,151	423,932	2041/3/28	IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	750	926	124,669	2023/3/20		
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,050	2,600	349,754	2021/9/28	IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	850	1,000	134,515	2019/6/18		
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,450	3,173	426,862	2022/9/28	IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	1,600	1,927	259,208	2020/4/18		
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,000	1,403	188,784	2026/3/28	IRISH 4.5% 10/18/18	4.5	1,650	1,908	256,770	2018/10/18		
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,700	4,568	614,515	2035/3/28	IRISH 4.6% 04/18/16	4.6	1,050	1,107	148,903	2016/4/18		
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,250	3,553	477,983	2028/3/28	IRISH 5% 10/18/20	5.0	1,250	1,560	209,875	2020/10/18		
BGB 5.5% 09/28/17	5.5	950	1,090	146,655	2017/9/28	IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,650	2,308	310,553	2025/3/13		
(オーストリア) 国債証券						IRISH 5.5% 10/18/17	5.5	800	915	123,092	2017/10/18		
RAGB 1.15% 10/19/18	1.15	800	836	112,523	2018/10/19	IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	850	1,067	143,648	2019/10/18		
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	400	445	59,955	2024/10/21	小 計				101,531,481			
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	700	784	105,481	2023/10/20	(イギリス) 国債証券							
RAGB 1.95% 06/18/19	1.95	1,150	1,249	168,131	2019/6/18	UKT 1% 09/07/17	1.0	3,650	3,675	666,200	2017/9/7		
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	500	637	85,770	2034/5/23	UKT 1.25% 07/22/18	1.25	4,550	4,594	832,802	2018/7/22		
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	750	1,056	155,500	2044/6/20	UKT 1.75% 01/22/17	1.75	2,900	2,965	537,538	2017/1/22		
RAGB 3.2% 02/20/17	3.2	1,050	1,121	150,827	2017/2/20	UKT 1.75% 07/22/19	1.75	3,350	3,436	622,947	2019/7/22		
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	1,500	1,863	250,605	2022/11/22	UKT 1.75% 09/07/22	1.75	3,550	3,615	655,353	2022/9/7		
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	2,100	2,565	345,087	2021/9/15	UKT 2.25% 09/07/23	2.25	3,750	3,949	715,809	2023/9/7		
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	1,100	2,119	285,119	2022/4/20	UKT 2.75% 09/07/24	2.75	2,350	2,575	466,742	2024/9/7		
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	500	1,097	147,646	2062/1/26	UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,900	3,457	626,621	2044/1/22		
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	1,750	2,116	284,756	2020/7/15	UKT 3.5% 01/22/45	3.5	900	1,123	203,691	2045/1/22		
RAGB 4% 09/15/16	4.0	1,450	1,546	207,970	2016/9/15	UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,750	2,393	433,830	2068/7/22		
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,750	2,892	389,014	2037/3/15	UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,700	2,311	418,977	2052/7/22		
RAGB 4.3% 09/15/17	4.3	1,350	1,505	202,501	2017/9/15	UKT 3.75% 09/07/19	3.75	1,500	1,675	303,678	2019/9/7		
RAGB 4.35% 03/15/19	4.35	2,200	2,597	349,417	2019/3/15	UKT 3.75% 09/07/20	3.75	3,750	4,252	770,721	2020/9/7		
RAGB 4.65% 01/15/18	4.65	1,700	1,937	260,623	2018/1/15	UKT 3.75% 09/07/21	3.75	3,500	4,026	729,781	2021/9/7		
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,200	1,761	237,006	2026/3/15	UKT 4% 01/22/60	4.0	2,000	2,971	538,566	2060/1/22		
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	850	1,433	192,757	2027/7/15	UKT 4% 03/07/22	4.0	2,600	3,054	553,591	2022/3/7		
(フィンランド) 国債証券						UKT 4% 09/07/16	4.0	3,000	3,167	574,156	2016/9/7		
RFIG 1.125% 09/15/18	1.125	550	574	77,294	2018/9/15	UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,750	3,690	668,828	2036/3/7		
RFIG 1.5% 04/15/23	1.5	600	657	88,375	2023/4/15	UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,850	3,749	679,576	2032/6/7		
RFIG 1.625% 09/15/22	1.625	650	716	96,369	2022/9/15	UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,900	2,607	472,578	2039/9/7		
RFIG 1.75% 04/15/16	1.75	850	869	116,911	2016/4/15	UKT 4.25% 12/07/27	4.25	2,100	2,679	485,677	2027/12/7		
RFIG 1.875% 04/15/17	1.875	900	940	126,481	2017/4/15	UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,450	3,382	613,072	2040/12/7		
RFIG 2% 04/15/24	2.0	750	857	115,282	2024/4/15	UKT 4.25% 12/07/46	4.25	3,050	4,382	794,289	2046/12/7		
RFIG 2.625% 07/04/42	2.625	500	705	94,912	2042/7/4	UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,500	2,202	399,185	2049/12/7		
RFIG 2.75% 07/04/28	2.75	700	886	119,211	2028/7/4	UKT 4.25% 12/07/55	4.25	2,400	3,657	662,892	2055/12/7		
RFIG 3.375% 04/15/20	3.375	1,250	1,468	197,478	2020/4/15	UKT 4.5% 03/07/19	4.5	3,800	4,327	784,269	2019/3/7		
RFIG 3.5% 04/15/21	3.5	900	1,088	146,352	2021/4/15	UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,830	3,880	703,383	2034/9/7		
RFIG 3.875% 09/15/17	3.875	700	773	104,045	2017/9/15	UKT 4.5% 12/07/42	4.5	3,150	4,576	829,497	2042/12/7		
RFIG 4% 07/04/25	4.0	800	1,085	146,031	2025/7/4	UKT 4.75% 03/07/20	4.75	2,750	3,229	585,392	2020/3/7		
RFIG 4.375% 07/04/19	4.375	800	955	128,571	2019/7/4	UKT 4.75% 12/07/30	4.75	2,620	3,601	652,699	2030/12/7		
(アイルランド) 国債証券						UKT 4.75% 12/07/38	4.75	2,250	3,289	596,160	2038/12/7		
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	300	301	40,556	2022/3/15	UKT 5% 03/07/18	5.0	2,050	2,309	418,654	2018/3/7		
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	600	670	90,248	2030/5/15	UKT 5% 03/07/25	5.0	2,350	3,079	558,180	2025/3/7		
小 計						UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,350	2,034	368,670	2028/12/7		
						UKT 8% 06/07/21	8.0	1,300	1,827	331,208	2021/6/7		
						UKT 8.75% 08/25/17	8.75	1,070	1,290	233,816	2017/8/25		
						小 計				20,489,046			

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千スイスフラン	外貨建金額	千スイスフラン	邦貨換算金額				千ポロランドズロチ	外貨建金額	千ポロランドズロチ	邦貨換算金額	
(スイス) 国債証券							(オーストラリア) 国債証券						
SWISS 2% 04/28/21	2.0	500	576	74,136	2021/4/28	POLGB 4.75% 10/25/16	4.75	3,150	3,315	107,391	2016/10/25		
SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	750	864	111,123	2020/7/6	POLGB 5% 04/25/16	5.0	3,250	3,379	109,477	2016/4/25		
SWISS 2.5% 03/12/16	2.5	600	623	80,151	2016/3/12	POLGB 5.25% 10/25/17	5.25	3,000	3,280	106,240	2017/10/25		
SWISS 3% 01/08/18	3.0	1,000	1,113	143,163	2018/1/8	POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	2,950	3,473	112,511	2020/10/25		
SWISS 3% 05/12/19	3.0	750	870	111,872	2019/5/12	POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	3,050	3,545	114,850	2019/10/25		
SWISS 4% 02/11/23	4.0	550	738	94,909	2023/2/11	POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	1,400	1,982	64,216	2029/4/25		
SWISS 4% 04/08/28	4.0	770	1,169	150,374	2028/4/8	POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	2,700	3,396	110,011	2022/9/23		
SWISS 4.25% 06/05/17	4.25	1,050	1,179	151,565	2017/6/5	POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	1,850	2,282	73,939	2021/10/25		
小 計				917,297		小 計				1,420,087			
(スウェーデン) 国債証券						(オーストラリア) 国債証券							
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	9,300	10,072	142,322	2023/11/13	ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,600	2,674	246,451	2024/4/21		
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	6,300	7,457	105,372	2025/5/12	ACGB 2.75% 10/21/19	2.75	300	309	28,568	2019/10/21		
SGB 3% 07/12/16	3.0	8,000	8,354	118,045	2016/7/12	ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,100	2,248	207,216	2025/4/21		
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	6,750	9,972	140,906	2039/3/30	ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,100	1,173	108,183	2029/4/21		
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	8,350	10,236	144,636	2022/6/1	ACGB 3.25% 10/21/18	3.25	1,400	1,464	135,013	2018/10/21		
SGB 3.75% 08/12/17	3.75	9,100	9,996	141,254	2017/8/12	ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,000	1,133	104,501	2037/4/21		
SGB 4.25% 03/12/19	4.25	13,600	15,998	226,060	2019/3/12	ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,750	2,043	188,294	2026/4/21		
SGB 5% 12/01/20	5.0	8,400	10,736	151,704	2020/12/1	ACGB 4.25% 07/21/17	4.25	2,500	2,637	243,081	2017/7/21		
小 計				1,170,302		ACGB 4.5% 04/15/20	4.5	2,900	3,248	299,382	2020/4/15		
(ノルウェー) 国債証券						(オーストラリア) 国債証券							
NGB 2% 05/24/23	2.0	6,700	7,131	111,177	2023/5/24	ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,350	1,675	154,445	2033/4/21		
NGB 3% 03/14/24	3.0	6,000	6,891	107,435	2024/3/14	ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	1,950	2,391	220,363	2027/4/21		
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	8,900	10,425	162,539	2021/5/25	ACGB 4.75% 06/15/16	4.75	2,650	2,746	253,133	2016/6/15		
NGB 4.25% 05/19/17	4.25	9,150	9,878	154,004	2017/5/19	ACGB 5.25% 03/15/19	5.25	3,100	3,499	322,477	2019/3/15		
NGB 4.5% 05/22/19	4.5	8,100	9,370	146,087	2019/5/22	ACGB 5.5% 01/21/18	5.5	3,200	3,526	324,966	2018/1/21		
小 計				681,244		ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	3,050	3,764	346,901	2023/4/21		
(デンマーク) 国債証券						(オーストラリア) 国債証券							
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	9,750	10,959	198,031	2023/11/15	ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	3,300	3,989	367,637	2021/5/15		
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	3,950	4,584	82,842	2025/11/15	ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	2,000	2,473	227,937	2022/7/15		
DGB 2.5% 11/15/16	2.5	7,050	7,451	134,655	2016/11/15	ACGB 6% 02/15/17	6.0	3,100	3,346	308,451	2017/2/15		
DGB 3% 11/15/21	3.0	12,900	15,608	282,052	2021/11/15	小 計				4,087,008			
DGB 4% 11/15/17	4.0	6,650	7,506	135,649	2017/11/15	(シンガポール) 国債証券							
DGB 4% 11/15/19	4.0	14,300	17,327	313,114	2019/11/15	SIGB 0.5% 04/01/18	0.5	700	691	60,751	2018/4/1		
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	16,850	31,033	560,784	2039/11/15	SIGB 1.125% 04/01/16	1.125	1,000	1,004	88,217	2016/4/1		
DGB 7% 11/10/24	7.0	4,100	6,867	124,093	2024/11/10	SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	720	744	65,390	2021/6/1		
小 計				1,831,224		SIGB 2.375% 04/01/17	2.375	550	568	49,969	2017/4/1		
(ポーランド) 国債証券						(シンガポール) 国債証券							
POLGB 0% 07/25/16	—	1,350	1,318	42,715	2016/7/25	SIGB 2.5% 06/01/19	2.5	850	895	78,644	2019/6/1		
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	3,800	3,891	126,045	2018/7/25	SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	400	420	36,914	2042/4/1		
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	2,550	2,698	87,418	2019/7/25	SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	550	587	51,601	2023/7/1		
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	1,550	1,698	55,020	2025/7/25	SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	300	321	28,254	2029/7/1		
POLGB 3.75% 04/25/18	3.75	2,200	2,335	75,661	2018/4/25	SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	250	267	23,516	2030/9/1		
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,850	4,414	142,987	2023/10/25	SIGB 3% 09/01/24	3.0	800	876	77,029	2024/9/1		
POLGB 4.75% 04/25/17	4.75	2,650	2,828	91,600	2017/4/25	SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	600	656	57,695	2022/9/1		
						SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	600	653	57,435	2020/9/1		
						SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	450	517	45,458	2033/9/1		
						SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	750	857	75,320	2027/3/1		
						SIGB 3.75% 09/01/16	3.75	880	920	80,887	2016/9/1		
						SIGB 4% 09/01/18	4.0	700	772	67,909	2018/9/1		
小 計				944,997		小 計				944,997			

銘柄	利率	期末			償還年月日
		額面金額	評価額	額	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(マレーシア) 国債証券	%	千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット	千円	
MGS 3.172% 07/15/16	3.172	950	947	31,639	2016/7/15
MGS 3.26% 03/01/18	3.26	1,200	1,188	39,689	2018/3/1
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	1,950	1,907	63,723	2022/8/15
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	1,600	1,564	52,268	2023/3/15
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	3,000	2,974	99,357	2020/3/31
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,300	1,233	41,208	2027/5/31
MGS 3.58% 09/28/18	3.58	1,800	1,798	60,074	2018/9/28
MGS 3.814% 02/15/17	3.814	1,600	1,610	53,780	2017/2/15
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	850	805	26,895	2033/4/15
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,050	1,060	35,428	2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	640	633	21,165	2027/3/15
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	850	837	27,959	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	2,900	2,973	99,315	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	900	929	31,061	2024/7/15
MGS 4.24% 02/07/18	4.24	3,800	3,870	129,265	2018/2/7
MGS 4.262% 09/15/16	4.262	5,350	5,422	181,112	2016/9/15
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	3,500	3,611	120,619	2019/11/29
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,600	1,676	55,997	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	950	994	33,208	2030/4/15
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	600	634	21,177	2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	1,050	1,177	39,317	2028/9/15
小計				1,264,264	
(南アフリカ) 国債証券		千南アフリ カランド	千南アフリ カランド		
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	20,750	25,672	265,450	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	12,950	10,677	110,405	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	12,100	10,103	104,470	2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	12,650	12,473	128,977	2021/3/31

銘柄	利率	期末			償還年月日
		額面金額	評価額	額	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千南アフリ カランド	千南アフリ カランド	千円	
SAGB 7% 02/28/31	7.0	13,450	12,417	128,398	2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	10,750	10,906	112,773	2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	6,750	6,973	72,108	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	3,150	3,207	33,168	2030/1/31
SAGB 8% 12/21/18	8.0	12,100	12,595	130,239	2018/12/21
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	2,700	2,772	28,665	2032/3/31
SAGB 8.25% 09/15/17	8.25	11,400	11,854	122,579	2017/9/15
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	3,300	3,457	35,751	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	2,300	2,466	25,506	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	7,150	7,700	79,619	2048/2/28
小計				1,378,114	
合計				244,998,400	

(注) 邦貨換算金額は、当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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外 EURO-SCHATZ	478	—
US 5YR NOTE	727	—
EURO-BOBL FU	616	—
EURO-BUND	1,363	—
US 10YR NOTE	459	—
US LONG BOND	403	—

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

投資信託財産の構成

項目	期末	
	評価額	比率
公社債	千円 244,998,400	% 96.5
コール・ローン等、その他	8,858,232	3.5
投資信託財産総額	253,856,632	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(247,741,916千円)の投資信託財産総額(253,856,632千円)に対する比率は97.6%です。
(注2) 外貨建資産は、当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。1米ドル=118.91円、1カナダドル=94.99円、1メキシコペソ=8.01円、1ユーロ=134.51円、1イギリスポンド=181.25円、1スイスフラン=128.54円、1スウェーデンクローナ=14.13円、1ノルウェークローネ=15.59円、1デンマーククローネ=18.07円、1ポーランドズロチ=32.39円、1オーストラリアドル=92.16円、1シンガポールドル=87.86円、1マレーシアリンギット=33.40円、1南アフリカカランド=10.34円です。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2015年2月9日現在
(A) 資 産	259,071,196,300円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,223,646,138
公 社 債(評価額)	244,998,400,377
未 収 入 金	5,274,716,966
未 収 利 息	2,326,713,326
前 払 費 用	38,860,807
差 入 委 託 証 拠 金	208,858,686
(B) 負 債	5,896,591,430
未 払 金	5,364,677,045
未 払 解 約 金	531,914,385
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	253,174,604,870
元 本	103,843,277,886
次 期 繰 越 損 益 金	149,331,326,984
(D) 受 益 権 総 口 数	103,843,277,886口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,380円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2014年2月8日 至 2015年2月9日
(A) 配 当 等 収 益	8,236,727,752円
受 取 利 息	8,236,727,752
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	34,342,641,149
売 買 益	39,685,903,732
売 買 損	△5,343,262,583
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	232,893,675
取 引 益	333,002,534
取 引 損	△100,108,859
(D) 保 管 費 用 等	△36,789,981
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	42,775,472,595
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	172,355,634,168
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,966,755,992
(H) 解 約 差 損 益 金	△77,766,535,771
(I) 計 (E+F+G+H)	149,331,326,984
次 期 繰 越 損 益 金(I)	149,331,326,984

(注1) (B)有価証券売買損益及び(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (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。

(注3) (H)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。

お知らせ

当ファンドのベンチマークの名称を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2014年2月11日)

運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2014年12月1日)

一般社団法人投資信託協会「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2015年1月24日)