

## 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ることとし、実質投資割合は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、)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。
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7期(決算日 2017年2月7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。
- ・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	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				
第3期(2013年2月7日)	円	円	%			%	%	%	百万円
	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	
第6期(2016年2月8日)	14,062	0	△2.3	459.396	△2.1	97.7	0.9	4,059	
第7期(2017年2月7日)	12,957	0	△7.9	428.463	△6.7	97.6	0.9	3,598	

(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		債券組入率	債券先物率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首)	円	%			%	%
2016年 2月8日	14,062	—	459.396	—	97.7	0.9
2月末	13,564	△3.5	444.836	△3.2	97.5	1.0
3月末	13,806	△1.8	451.281	△1.8	96.7	1.5
4月末	13,357	△5.0	443.058	△3.6	97.0	1.3
5月末	13,468	△4.2	441.613	△3.9	96.6	1.7
6月末	12,707	△9.6	415.449	△9.6	96.9	1.5
7月末	12,921	△8.1	425.076	△7.5	96.0	2.2
8月末	12,813	△8.9	419.023	△8.8	97.0	1.6
9月末	12,565	△10.6	414.999	△9.7	97.3	1.2
10月末	12,583	△10.5	414.548	△9.8	97.0	1.5
11月末	13,091	△6.9	431.000	△6.2	98.1	0.7
12月末	13,487	△4.1	442.149	△3.8	98.0	0.7
2017年 1月末	13,154	△6.5	432.597	△5.8	97.7	0.8
(当期末)						
2017年 2月7日	12,957	△7.9	428.463	△6.7	97.6	0.9

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

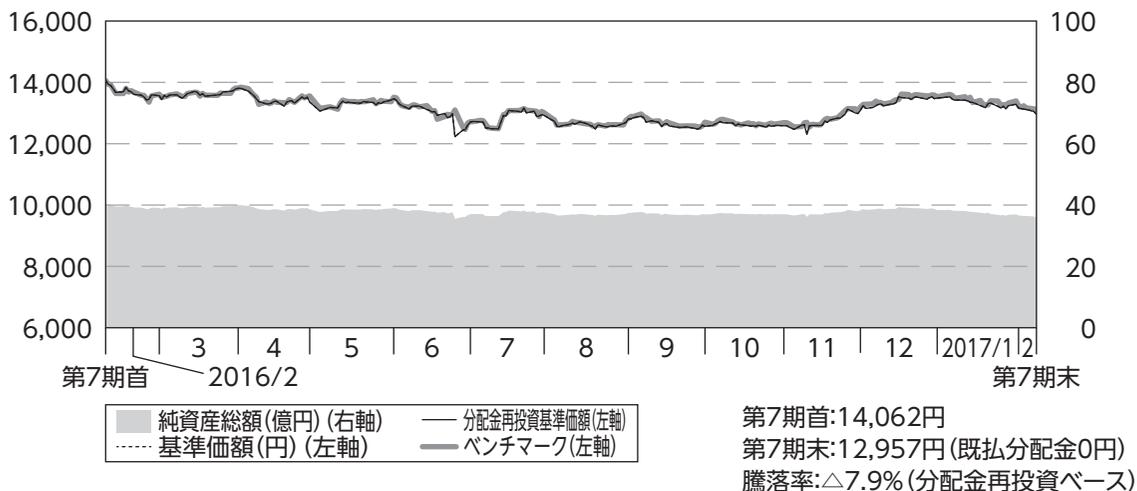
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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、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

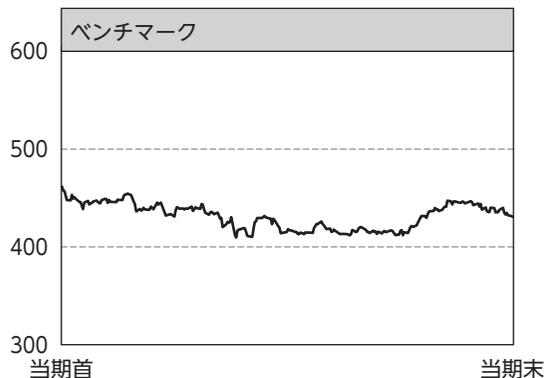


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2016年2月8日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

## 基準価額の主な変動要因

基準価額は、2016年6月にかけて、米国の利上げペースは緩やかになるという見方が強まったことなどを背景に外国為替市場で円高基調となったことから、下落推移となりました。6月下旬には、英国の国民投票において大方の予想に反してEU(欧州連合)離脱派が勝利したことを受けてリスク回避姿勢が強まり、金利は低下(債券価格は上昇)したものの円高が一段と進んだことから、基準価額は下落しました。7月中旬には、日銀による追加金融緩和策への期待の高まりから円安となり、基準価額は一旦上昇しましたが、8月初めには日銀による政策期待が後退したことから円高となり、下落しました。11月までもみ合い推移の後、11月上旬から12月にかけては、米国の次期政権下での経済政策への思惑や利上げ観測の強まりなどを背景に金利が上昇(債券価格は下落)したものの、外国為替市場で円安に転じたことから、基準価額は上昇しました。その後期末にかけては、米トランプ政権の政策不透明感の高まりから円高となり、基準価額は下落しました。

## 投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、6月下旬に英国においてEU離脱の是非を問う国民投票の結果が大方の予想に反してEU離脱派の勝利となったことを受けて、リスク回避姿勢が強まり、低下しました。11月以降は米国の早期利上げ観測やトランプ次期政権下での経済政策への思惑などから、金利上昇圧力がかかりました。

外国為替市場では、9月にかけては米国の利上げペースは緩やかになるという見方や、英国のEU離脱懸念を背景としたリスク回避姿勢の強まりから、円高基調で推移しました。その後は、米国の利上げ観測の強まりなどから円安方向に転じました。

## 当ファンドのポートフォリオ

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、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。

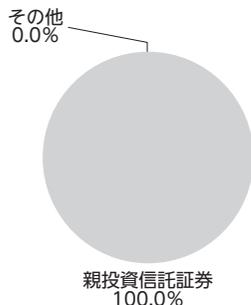
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

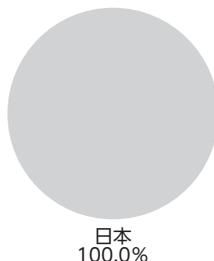
	当期末
	2017年2月7日
外国債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

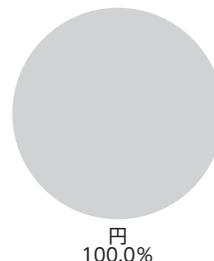
### ○資産別配分



### ○国別配分



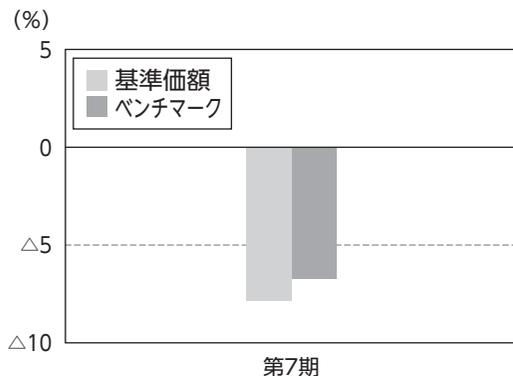
### ○通貨別配分



(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。

## 当ファンド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(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離が生じた主要因は、信託報酬、為替評価差<sup>(※1)</sup>、債券の価格評価差<sup>(※2)</sup>等です。

(※1)当ファンドとベンチマーク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。

(※2)当ファンドとベンチマークで債券の価格評価レートが異なることによる差異です。

## 分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。  
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7期	
	2016年2月9日~2017年2月7日	
当期分配金 (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 (円)	4,848	

(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、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
	(2016年2月9日～2017年2月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	71円	0.539%	(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13,126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)	(27)	(0.205)	
(販売会社)	(38)	(0.291)	
(受託会社)	(6)	(0.043)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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	2	0.018	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(2)	(0.012)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	73	0.558	

(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。

## 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 86,588	千円 192,264	千口 160,244	千円 362,866

## 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			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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 346	百万円 346	% 100.0	百万円 346	百万円 346	% 100.0
コール・ローン	1,600	270	16.9	1,602	270	16.9

(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。

### <外国債券マザーファンド>

区 分	当 期			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	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 59,529	百万円 59,529	% 100.0	百万円 59,533	百万円 59,533	% 100.0
為替直物取引	9,556	9,482	99.2	15,808	15,670	99.1
金 銭 信 託	186,417	186,417	100.0	186,417	186,417	100.0
コール・ローン	476,211	77,519	16.3	476,245	77,320	16.2

<平均保有割合 2.2%>

(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 1,694,529	千口 1,620,873	千円 3,598,015

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、73,249,993千口です。

※ 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	3,598,015	99.6
コール・ローン等、その他	13,309	0.4
投資信託財産総額	3,611,324	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(160,439,924千円)の投資信託財産総額(162,859,481千円)に対する比率は98.5%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=111.75円	1カナダドル=85.29円	1メキシコペソ=5.43円
1ユーロ=119.86円	1イギリスポンド=139.40円	1スイスフラン=112.58円
1スウェーデンクローナ=12.64円	1ノルウェークローネ=13.51円	1デンマーククローネ=16.12円
1ポーランドズロチ=27.92円	1オーストラリアドル=85.35円	1シンガポールドル=79.10円
1マレーシアリンギット=25.23円	1南アフリカランド=8.38円	

## 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 2017年2月7日現在
(A) 資 産	3,611,324,379円
コール・ローン等	11,073,839
外国債券マザーファンド(評価額)	3,598,015,090
未 収 入 金	2,235,450
(B) 負 債	13,281,832
未 払 解 約 金	3,073,065
未 払 信 託 報 酬	10,107,734
未 払 利 息	14
そ の 他 未 払 費 用	101,019
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,598,042,547
元 本	2,776,814,806
次 期 繰 越 損 益 金	821,227,741
(D) 受 益 権 総 口 数	2,776,814,806口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,957円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年2月9日 至 2017年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	△4,305円
受 取 利 息	54
支 払 利 息	△4,359
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△248,194,251
売 買 益	38,692,908
売 買 損	△286,887,159
(C) 信 託 報 酬 等	△286,620,109
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△268,818,665
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	305,459,524
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	784,586,882
(配 当 等 相 当 額)	(822,893,776)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△38,306,894)
(G) 計 (D+E+F)	821,227,741
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	821,227,741
追 加 信 託 差 損 益 金	784,586,882
(配 当 等 相 当 額)	(823,242,117)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△38,655,235)
分 配 準 備 積 立 金	523,186,703
繰 越 損 益 金	△486,545,844

(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2,887,070,320円、期中追加設定元本額は422,636,295円、期中一部解約元本額は532,891,809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)	70,535,549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)	－円
(C) 収益調整金額	823,242,117円
(D) 分配準備積立金額	452,651,154円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	1,346,428,820円
(F) 期末残存口数	2,776,814,806口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	4,848円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国債券マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2017年2月7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
第15期(2016年2月8日)	23,958	△1.7	459,396	△2.1	97.7	0.9	181,815
第16期(2017年2月7日)	22,198	△7.3	428,463	△6.7	97.6	0.9	162,596

(注)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		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2016年2月8日	23,958	－	459,396	－	97.7	0.9
2月末	23,117	△3.5	444,836	△3.2	97.5	1.0
3月末	23,540	△1.7	451,281	△1.8	96.7	1.5
4月末	22,784	△4.9	443,058	△3.6	97.0	1.3
5月末	22,985	△4.1	441,613	△3.9	96.6	1.7
6月末	21,695	△9.4	415,449	△9.6	96.9	1.5
7月末	22,071	△7.9	425,076	△7.5	96.0	2.2
8月末	21,896	△8.6	419,023	△8.8	97.0	1.6
9月末	21,482	△10.3	414,999	△9.7	97.3	1.2
10月末	21,524	△10.2	414,548	△9.8	97.0	1.5
11月末	22,402	△6.5	431,000	△6.2	98.1	0.7
12月末	23,092	△3.6	442,149	△3.8	98.0	0.7
2017年1月末	22,533	△5.9	432,597	△5.8	97.7	0.8
(当期末) 2017年2月7日	22,198	△7.3	428,463	△6.7	97.6	0.9

(注1)騰落率は期首比です。

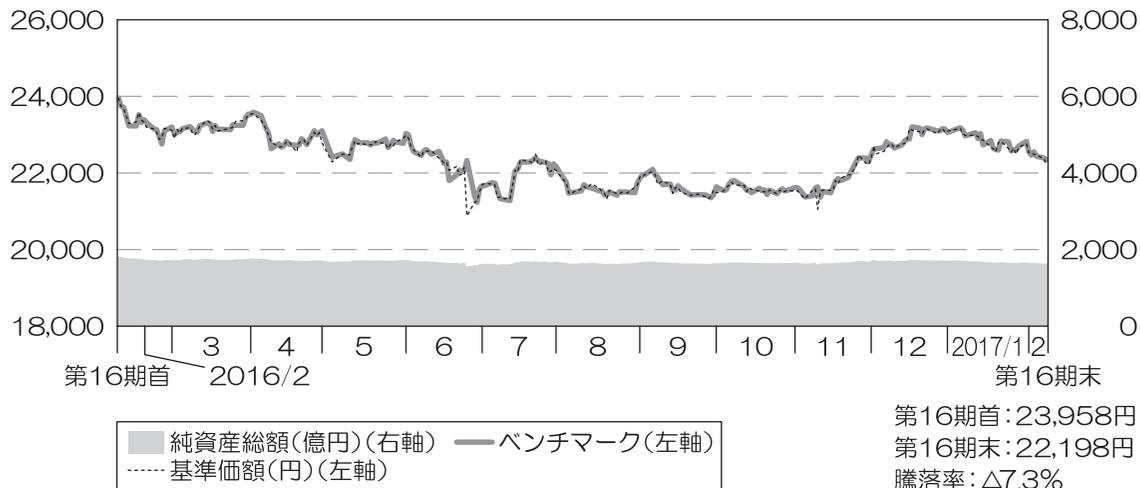
(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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)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、2016年2月8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

基準価額は、2016年6月にかけて、米国の利上げペースは緩やかになるという見方が強まったことなどを背景に外国為替市場で円高基調となったことから、下落推移となりました。6月下旬には、英国の国民投票において大方の予想に反してEU(欧州連合)離脱派が勝利したことを受けてリスク回避姿勢が強まり、金利は低下(債券価格は上昇)したものの円高が一段と進んだことから、基準価額は下落しました。7月中旬には、日銀による追加金融緩和策への期待の高まりから円安となり、基準価額は一旦上昇しましたが、8月初めには日銀による政策期待が後退したことから円高となり、下落しました。11月までもみ合い推移の後、11月上旬から12月にかけては、米国の次期政権下での経済政策への思惑や利上げ観測の強まりなどを背景に金利が上昇(債券価格は下落)したものの、外国為替市場で円安に転じたことから、基準価額は上昇しました。その後期末にかけては、米トランプ政権の政策不透明感の高まりから円高となり、基準価額は下落しました。

## 投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、6月下旬に英国においてEU離脱の是非を問う国民投票の結果が大方の予想に反してEU離脱派の勝利となったことを受けて、リスク回避姿勢が強まり、低下しました。11月以降は米国の早期利上げ観測やトランプ次期政権下での経済政策への思惑などから、金利上昇圧力がかかりました。

外国為替市場では、9月にかけては米国の利上げペースは緩やかになるという見方や、英国のEU離脱懸念を背景としたリスク回避姿勢の強まりから、円高基調で推移しました。その後は、米国の利上げ観測の強まりなどから円安方向に転じました。

## 当ファンドのポートフォリオ

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、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、先物を含む実質の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。

当ファンドの組入資産の内容

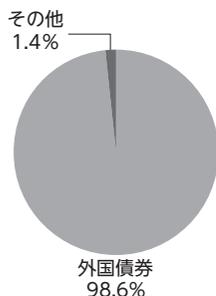
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	0.7%
2	T 2.5% 02/15/46	アメリカ	0.7%
3	T 1.25% 11/15/18	アメリカ	0.6%
4	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	0.6%
5	T 1.375% 04/30/20	アメリカ	0.6%
6	T 2.875% 08/15/45	アメリカ	0.6%

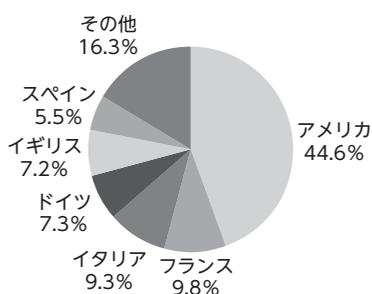
順位	銘柄名	国	組入比率
7	T 1.625% 04/30/23	アメリカ	0.5%
8	T 2% 08/15/25	アメリカ	0.5%
9	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	0.5%
10	T 3.125% 08/15/44	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		636	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

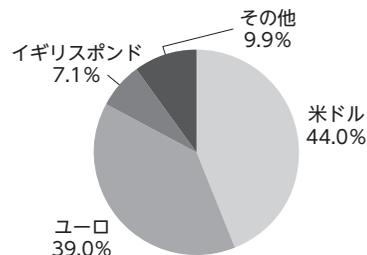
○資産別配分



○国別配分



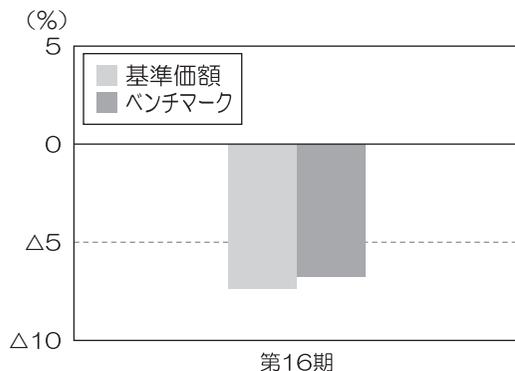
○通貨別配分



(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。

## 当ファンド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。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差<sup>(※1)</sup>と債券の価格評価差<sup>(※2)</sup>等です。

(※1) 当ファンドとベンチマーク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。

(※2) 当ファンドとベンチマークで債券の価格評価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、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
	(2016年2月9日～2017年2月7日)		
	金額	比率	
<b>(a) 売買委託手数料</b>	<b>0円</b>	<b>0.001%</b>	$(a) \text{ 売買委託手数料} = \frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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)	(0.001)	
<b>(b) 有価証券取引税</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	$(b) \text{ 有価証券取引税} = \frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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)	(-)	(-)	
<b>(c) その他費用</b>	<b>3</b>	<b>0.013</b>	$(c) \text{ その他費用} = \frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(3)	(0.012)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
<b>合計</b>	<b>3</b>	<b>0.014</b>	

(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(22,426円)で除して100を乗じたものです。

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 188,605	千米ドル 184,697
	カ ナ ダ	国債証券	千カナダドル 13,553	千カナダドル 12,956
	メ キ シ コ	国債証券	千メキシコペソ 41,136	千メキシコペソ 42,187
	ド イ ツ	国債証券	千ユーロ 24,640	千ユーロ 28,285
	イ タ リ ア	国債証券	28,783	29,709
	フ ラ ン ス	国債証券	27,163	25,911
	オ ラ ン ダ	国債証券	6,478	9,483
	ス ペ イ ン	国債証券	15,327	16,502
	ベ ル ギ ー	国債証券	4,752	5,818
	オ ー ス ト リ ア	国債証券	3,166	5,079
フ ィ ン ラ ン ド	国債証券	1,321	1,827	
ア イ ル ラ ン ド	国債証券	1,267	1,624	
国	イ ギ リ ス	国債証券	千イギリスポンド 10,436	千イギリスポンド 14,289
	ス イ ス	国債証券	千スイスフラン 77	千スイスフラン 1,566
	ス ウ ェ ー デ ン	国債証券	千スウェーデンクローナ 8,346	千スウェーデンクローナ 9,037
	ノ ル ウ ェ ー	国債証券	千ノルウェークローネ 5,766	千ノルウェークローネ 8,040
	デ ン マ ー ク	国債証券	千デンマーククローネ 10,119	千デンマーククローネ 15,324
	ポ ー ラ ン ド	国債証券	千ポーランドズロチ 10,850	千ポーランドズロチ 6,612
	オ ー ス ト ラ リ ア	国債証券	千オーストラリアドル 11,524	千オーストラリアドル 8,875
	シ ン ガ ポ ー ル	国債証券	千シンガポールドル 1,605	千シンガポールドル 1,521
	マ レ ー シ ア	国債証券	千マレーシアリンギット 7,276	千マレーシアリンギット 8,390
	南 ア フ リ カ	国債証券	千南アフリカランド 14,697	千南アフリカランド 10,801

(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 27,260	百万円 27,314	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人<sup>※</sup>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	$\frac{D}{C}$ %
為 替 先 物 取 引	百万円 59,529	百万円 59,529	100.0	百万円 59,533	百万円 59,533	100.0
為 替 直 物 取 引	9,556	9,482	99.2	15,808	15,670	99.1
金 銭 信 託	186,417	186,417	100.0	186,417	186,417	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	476,211	77,519	16.3	476,245	77,320	16.2

(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 626,610	千米ドル 634,933	千円 70,953,805	43.6	—	18.0	18.0	7.6
カ ナ ダ	千カナダドル 37,550	千カナダドル 41,150	3,509,703	2.2	—	1.0	0.7	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 227,550	千メキシコペソ 232,829	1,264,264	0.8	—	0.4	0.2	0.2
ド イ ツ	千ユーロ 81,020	千ユーロ 96,778	11,599,892	7.1	—	4.0	2.2	0.9
イ タ リ ア	108,570	123,939	14,783,485	9.1	—	5.5	2.7	0.9
フ ラ ン ス	110,580	128,749	15,431,882	9.5	—	5.8	2.8	0.9
オ ラ ン ダ	24,950	29,881	3,581,545	2.2	—	1.4	0.6	0.2
ス ベ イ ン	62,160	72,396	8,677,397	5.3	—	3.1	1.7	0.6
ベ ル ギ ー	27,640	33,178	3,976,796	2.4	—	1.8	0.5	0.1
オ ー ス ト リ ア	15,830	19,202	2,301,563	1.4	—	1.0	0.4	0.0
フ ィ ン ラ ン ド	6,990	7,895	946,329	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ア イ ル ラ ン ド	9,090	10,353	1,241,001	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 65,580	千イギリスポンド 82,337	11,477,854	7.1	—	5.1	1.6	0.4
ス イ ス	千スイスフラン 2,300	千スイスフラン 2,795	314,692	0.2	—	0.1	0.1	—
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 51,100	千スウェーデンクローナ 58,928	744,852	0.5	—	0.3	0.2	—
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 30,980	千ノルウェークローネ 33,258	449,318	0.3	—	0.1	0.1	—
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 46,730	千デンマーククローネ 58,887	949,267	0.6	—	0.3	0.2	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 35,610	千ポーランドズロチ 36,277	1,012,860	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 36,690	千オーストラリアドル 39,277	3,352,346	2.1	—	1.3	0.7	0.1
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 7,540	千シンガポールドル 7,860	621,786	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 28,110	千マレーシアリンギット 28,093	708,805	0.4	—	0.2	0.1	0.1
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド 112,640	千南アフリカランド 103,409	866,572	0.5	—	0.4	0.1	0.0
合 計	—	—	158,766,026	97.6	—	51.1	33.8	12.8

(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 0.625% 04/30/18	0.625	2,850	2,839	317,347	2018/4/30	T 1.5% 02/28/23	1.5	6,400	6,187	691,458	2023/2/28		
T 0.75% 02/28/18	0.75	4,500	4,494	502,252	2018/2/28	T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	3,862	431,609	2023/3/31		
T 0.75% 03/31/18	0.75	5,000	4,991	557,793	2018/3/31	T 1.5% 05/31/19	1.5	1,350	1,357	151,697	2019/5/31		
T 0.875% 01/31/18	0.875	2,000	2,000	223,552	2018/1/31	T 1.5% 08/15/26	1.5	8,300	7,655	855,459	2026/8/15		
T 0.875% 06/15/19	0.875	2,800	2,773	309,988	2019/6/15	T 1.5% 08/31/18	1.5	2,500	2,518	281,434	2018/8/31		
T 0.875% 07/31/19	0.875	5,000	4,948	553,007	2019/7/31	T 1.5% 10/31/19	1.5	3,200	3,210	358,816	2019/10/31		
T 0.875% 09/15/19	0.875	7,100	7,016	784,074	2019/9/15	T 1.5% 11/30/19	1.5	5,000	5,015	560,468	2019/11/30		
T 0.875% 10/15/18	0.875	6,000	5,980	668,368	2018/10/15	T 1.5% 12/31/18	1.5	2,500	2,516	281,264	2018/12/31		
T 1% 03/15/19	1.0	1,550	1,543	172,492	2019/3/15	T 1.625% 02/15/26	1.625	5,750	5,389	602,241	2026/2/15		
T 1% 05/15/18	1.0	7,000	7,007	783,062	2018/5/15	T 1.625% 03/31/19	1.625	4,400	4,438	496,040	2019/3/31		
T 1% 05/31/18	1.0	5,600	5,604	626,306	2018/5/31	T 1.625% 04/30/19	1.625	4,000	4,033	450,773	2019/4/30		
T 1% 06/30/19	1.0	1,200	1,192	133,220	2019/6/30	T 1.625% 04/30/23	1.625	8,100	7,870	879,519	2023/4/30		
T 1% 08/31/19	1.0	2,800	2,777	310,403	2019/8/31	T 1.625% 05/15/26	1.625	5,400	5,050	564,352	2026/5/15		
T 1% 09/15/18	1.0	2,350	2,348	262,460	2018/9/15	T 1.625% 05/31/23	1.625	4,350	4,222	471,868	2023/5/31		
T 1% 09/30/19	1.0	5,000	4,955	553,769	2019/9/30	T 1.625% 06/30/19	1.625	4,000	4,031	450,539	2019/6/30		
T 1% 11/30/19	1.0	2,600	2,573	287,542	2019/11/30	T 1.625% 07/31/19	1.625	3,500	3,526	394,109	2019/7/31		
T 1.125% 03/31/20	1.125	2,000	1,979	221,154	2020/3/31	T 1.625% 07/31/20	1.625	1,200	1,202	134,339	2020/7/31		
T 1.125% 05/31/19	1.125	2,850	2,841	317,541	2019/5/31	T 1.625% 08/15/22	1.625	1,400	1,374	153,558	2022/8/15		
T 1.125% 06/15/18	1.125	1,900	1,904	212,847	2018/6/15	T 1.625% 11/15/22	1.625	4,000	3,911	437,133	2022/11/15		
T 1.125% 06/30/21	1.125	4,000	3,889	434,618	2021/6/30	T 1.625% 12/31/19	1.625	2,250	2,264	253,017	2019/12/31		
T 1.125% 12/31/19	1.125	5,200	5,159	576,626	2019/12/31	T 1.75% 02/28/22	1.75	3,650	3,626	405,206	2022/2/28		
T 1.25% 01/31/20	1.25	4,000	3,979	444,698	2020/1/31	T 1.75% 05/15/22	1.75	4,600	4,556	509,208	2022/5/15		
T 1.25% 03/31/21	1.25	2,300	2,255	252,029	2021/3/31	T 1.75% 05/15/23	1.75	1,750	1,712	191,363	2023/5/15		
T 1.25% 04/30/19	1.25	2,000	2,000	223,567	2019/4/30	T 1.75% 10/31/18	1.75	1,800	1,820	203,442	2018/10/31		
T 1.25% 11/15/18	1.25	9,000	9,023	1,008,426	2018/11/15	T 1.75% 12/31/20	1.75	3,000	3,008	336,174	2020/12/31		
T 1.25% 12/15/18	1.25	5,500	5,512	616,039	2018/12/15	T 1.875% 05/31/22	1.875	7,250	7,225	807,473	2022/5/31		
T 1.25% 12/31/18	1.25	5,000	5,010	559,923	2018/12/31	T 1.875% 06/30/20	1.875	3,200	3,236	361,691	2020/6/30		
T 1.375% 02/28/19	1.375	4,050	4,066	454,382	2019/2/28	T 1.875% 08/31/22	1.875	2,600	2,583	288,664	2022/8/31		
T 1.375% 04/30/20	1.375	8,250	8,216	918,185	2020/4/30	T 1.875% 10/31/22	1.875	2,000	1,983	221,626	2022/10/31		
T 1.375% 04/30/21	1.375	3,000	2,953	330,087	2021/4/30	T 1.875% 11/30/21	1.875	3,500	3,504	391,609	2021/11/30		
T 1.375% 05/31/20	1.375	5,000	4,975	556,035	2020/5/31	T 2% 02/15/22	2.0	3,100	3,118	348,520	2022/2/15		
T 1.375% 06/30/18	1.375	3,500	3,520	393,440	2018/6/30	T 2% 02/15/23	2.0	6,500	6,473	723,394	2023/2/15		
T 1.375% 07/31/18	1.375	3,000	3,017	337,176	2018/7/31	T 2% 02/15/25	2.0	7,550	7,375	824,197	2025/2/15		
T 1.375% 08/31/20	1.375	3,350	3,324	371,546	2020/8/31	T 2% 02/28/21	2.0	6,150	6,220	695,179	2021/2/28		
T 1.375% 09/30/18	1.375	5,970	6,001	670,625	2018/9/30	T 2% 05/31/21	2.0	5,500	5,553	620,594	2021/5/31		
T 1.375% 09/30/20	1.375	5,200	5,156	576,272	2020/9/30	T 2% 07/31/20	2.0	4,000	4,059	453,656	2020/7/31		
T 1.375% 09/30/23	1.375	5,000	4,757	531,632	2023/9/30	T 2% 07/31/22	2.0	6,000	6,007	671,322	2022/7/31		
T 1.375% 10/31/20	1.375	6,000	5,944	664,314	2020/10/31	T 2% 08/15/25	2.0	7,950	7,726	863,456	2025/8/15		
T 1.375% 11/30/18	1.375	3,000	3,014	336,886	2018/11/30	T 2% 08/31/21	2.0	4,200	4,233	473,052	2021/8/31		
T 1.375% 12/31/18	1.375	3,700	3,716	415,325	2018/12/31	T 2% 10/31/21	2.0	4,200	4,228	472,547	2021/10/31		
T 1.5% 01/31/19	1.5	1,900	1,912	213,759	2019/1/31	T 2% 11/15/21	2.0	4,300	4,328	483,718	2021/11/15		
T 1.5% 01/31/22	1.5	3,000	2,946	329,269	2022/1/31	T 2% 11/30/20	2.0	2,800	2,835	316,888	2020/11/30		
T 1.5% 02/28/19	1.5	5,900	5,937	663,542	2019/2/28	T 2% 11/30/22	2.0	500	498	55,742	2022/11/30		
						T 2% 12/31/21	2.0	3,380	3,402	380,285	2021/12/31		

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	
T 2.125% 01/31/21	2.125	5,000	5,082	567,942	2021/1/31	T 3.125% 11/15/41	3.125	2,150	2,187	244,492	2041/11/15		
T 2.125% 05/15/25	2.125	5,250	5,164	577,140	2025/5/15	T 3.375% 05/15/44	3.375	1,500	1,591	177,895	2044/5/15		
T 2.125% 06/30/21	2.125	3,000	3,043	340,120	2021/6/30	T 3.375% 11/15/19	3.375	5,900	6,223	695,437	2019/11/15		
T 2.125% 06/30/22	2.125	1,100	1,109	123,951	2022/6/30	T 3.5% 02/15/18	3.5	3,650	3,747	418,729	2018/2/15		
T 2.125% 08/15/21	2.125	2,900	2,939	328,518	2021/8/15	T 3.5% 02/15/39	3.5	1,600	1,754	196,106	2039/2/15		
T 2.125% 08/31/20	2.125	1,000	1,018	113,826	2020/8/31	T 3.5% 05/15/20	3.5	4,050	4,305	481,135	2020/5/15		
T 2.125% 09/30/21	2.125	2,000	2,025	226,382	2021/9/30	T 3.625% 02/15/20	3.625	9,800	10,432	1,165,813	2020/2/15		
T 2.125% 12/31/22	2.125	4,600	4,617	516,007	2022/12/31	T 3.625% 02/15/21	3.625	4,050	4,355	486,782	2021/2/15		
T 2.25% 03/31/21	2.25	6,900	7,043	787,095	2021/3/31	T 3.625% 02/15/44	3.625	5,850	6,483	724,561	2044/2/15		
T 2.25% 04/30/21	2.25	4,700	4,796	535,991	2021/4/30	T 3.625% 08/15/19	3.625	5,500	5,814	649,802	2019/8/15		
T 2.25% 07/31/18	2.25	1,500	1,527	170,718	2018/7/31	T 3.625% 08/15/43	3.625	3,200	3,547	396,480	2043/8/15		
T 2.25% 07/31/21	2.25	4,500	4,586	512,563	2021/7/31	T 3.75% 08/15/41	3.75	1,100	1,241	138,748	2041/8/15		
T 2.25% 08/15/46	2.25	1,000	839	93,829	2046/8/15	T 3.75% 11/15/18	3.75	2,000	2,093	233,903	2018/11/15		
T 2.25% 11/15/24	2.25	5,000	4,986	557,244	2024/11/15	T 3.75% 11/15/43	3.75	1,400	1,586	177,302	2043/11/15		
T 2.25% 11/15/25	2.25	6,500	6,431	718,734	2025/11/15	T 3.875% 05/15/18	3.875	1,150	1,193	133,333	2018/5/15		
T 2.25% 12/31/23	2.25	3,500	3,515	392,826	2023/12/31	T 3.875% 08/15/40	3.875	1,550	1,785	199,496	2040/8/15		
T 2.375% 05/31/18	2.375	1,500	1,527	170,745	2018/5/31	T 4.0% 08/15/18	4.0	300	313	35,066	2018/8/15		
T 2.375% 06/30/18	2.375	2,500	2,548	284,806	2018/6/30	T 4.25% 05/15/39	4.25	1,200	1,461	163,300	2039/5/15		
T 2.375% 08/15/24	2.375	6,700	6,756	755,072	2024/8/15	T 4.25% 11/15/40	4.25	2,000	2,433	271,906	2040/11/15		
T 2.375% 12/31/20	2.375	7,200	7,392	826,121	2020/12/31	T 4.375% 02/15/38	4.375	700	872	97,505	2038/2/15		
T 2.5% 02/15/45	2.5	5,350	4,771	533,160	2045/2/15	T 4.375% 05/15/40	4.375	1,600	1,980	221,293	2040/5/15		
T 2.5% 02/15/46	2.5	11,350	10,091	1,127,776	2046/2/15	T 4.375% 05/15/41	4.375	1,350	1,673	187,009	2041/5/15		
T 2.5% 05/15/24	2.5	5,800	5,908	660,289	2024/5/15	T 4.375% 11/15/39	4.375	1,050	1,299	145,265	2039/11/15		
T 2.5% 08/15/23	2.5	5,000	5,108	570,892	2023/8/15	T 4.5% 02/15/36	4.5	1,800	2,281	254,986	2036/2/15		
T 2.625% 01/31/18	2.625	4,300	4,374	488,801	2018/1/31	T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,266	141,513	2038/5/15		
T 2.625% 04/30/18	2.625	3,600	3,674	410,624	2018/4/30	T 4.5% 08/15/39	4.5	1,250	1,573	175,844	2039/8/15		
T 2.625% 08/15/20	2.625	5,000	5,179	578,753	2020/8/15	T 4.625% 02/15/40	4.625	1,500	1,921	214,673	2040/2/15		
T 2.625% 11/15/20	2.625	2,350	2,434	272,071	2020/11/15	T 4.75% 02/15/41	4.75	1,100	1,435	160,469	2041/2/15		
T 2.75% 02/15/19	2.75	2,000	2,062	230,496	2019/2/15	T 5.0% 05/15/37	5.0	650	874	97,692	2037/5/15		
T 2.75% 02/15/24	2.75	8,000	8,289	926,362	2024/2/15	T 5.25% 02/15/29	5.25	500	641	71,638	2029/2/15		
T 2.75% 02/28/18	2.75	290	295	33,045	2018/2/28	T 5.25% 11/15/28	5.25	900	1,149	128,501	2028/11/15		
T 2.75% 08/15/42	2.75	2,550	2,415	269,977	2042/8/15	T 5.375% 02/15/31	5.375	1,450	1,938	216,574	2031/2/15		
T 2.75% 11/15/23	2.75	4,450	4,612	515,430	2023/11/15	T 5.5% 08/15/28	5.5	250	324	36,266	2028/8/15		
T 2.75% 11/15/42	2.75	2,900	2,745	306,765	2042/11/15	T 6.0% 02/15/26	6.0	600	777	86,845	2026/2/15		
T 2.875% 03/31/18	2.875	5,050	5,163	577,024	2018/3/31	T 6.125% 11/15/27	6.125	1,050	1,412	157,882	2027/11/15		
T 2.875% 05/15/43	2.875	6,700	6,485	724,792	2043/5/15	T 6.25% 05/15/30	6.25	1,200	1,701	190,184	2030/5/15		
T 2.875% 08/15/45	2.875	8,200	7,895	882,348	2045/8/15	T 6.25% 08/15/23	6.25	1,350	1,692	189,164	2023/8/15		
T 3% 05/15/42	3.0	2,450	2,436	272,244	2042/5/15	T 6.5% 11/15/26	6.5	450	610	68,171	2026/11/15		
T 3% 05/15/45	3.0	1,000	987	110,340	2045/5/15	T 8.0% 11/15/21	8.0	2,600	3,331	372,290	2021/11/15		
T 3% 11/15/44	3.0	2,050	2,026	226,471	2044/11/15	T 8.75% 08/15/20	8.75	1,800	2,241	250,504	2020/8/15		
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,800	1,830	204,610	2042/2/15								
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,600	2,637	294,788	2043/2/15	小 計				70,953,805			
T 3.125% 05/15/19	3.125	3,620	3,771	421,419	2019/5/15	(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル				
T 3.125% 05/15/21	3.125	6,250	6,601	737,678	2021/5/15	CAN 0.25% 05/01/18	0.25	1,000	995	84,899	2018/5/1		
T 3.125% 08/15/44	3.125	7,500	7,598	849,093	2044/8/15	CAN 0.5% 02/01/19	0.5	200	199	16,978	2019/2/1		

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		
		千カナダドル	外貨建金額				千カナダドル	外貨建金額		千メキシコペソ	外貨建金額
CAN 0.5% 03/01/22	0.5	200	193	16,529	2022/3/1	MEXICO 8.5% 11/18/38	8.5	9,950	10,438	56,681	2038/11/18
CAN 0.5% 08/01/18	0.5	1,700	1,695	144,630	2018/8/1	MEXICO 8.5% 12/13/18	8.5	21,600	22,243	120,782	2018/12/13
CAN 0.5% 11/01/18	0.5	1,450	1,445	123,244	2018/11/1	小 計				1,264,264	
CAN 0.75% 09/01/21	0.75	1,500	1,478	126,136	2021/9/1	(ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
CAN 1% 06/01/27	1.0	350	323	27,554	2027/6/1	DBR 0% 08/15/26	-	350	340	40,788	2026/8/15
CAN 1.25% 02/01/18	1.25	700	704	60,085	2018/2/1	DBR 0.25% 02/15/27	0.25	500	494	59,232	2027/2/15
CAN 1.25% 03/01/18	1.25	1,700	1,711	145,972	2018/3/1	DBR 0.5% 02/15/25	0.5	700	725	87,005	2025/2/15
CAN 1.25% 09/01/18	1.25	1,050	1,059	90,347	2018/9/1	DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,400	3,490	418,339	2026/2/15
CAN 1.5% 03/01/20	1.5	1,880	1,914	163,293	2020/3/1	DBR 1% 08/15/24	1.0	2,900	3,127	374,831	2024/8/15
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,500	1,513	129,098	2023/6/1	DBR 1% 08/15/25	1.0	2,750	2,956	354,388	2025/8/15
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,450	1,424	121,498	2026/6/1	DBR 1.5% 02/15/23	1.5	1,950	2,159	258,860	2023/2/15
CAN 1.75% 03/01/19	1.75	1,550	1,581	134,927	2019/3/1	DBR 1.5% 05/15/23	1.5	2,010	2,231	267,432	2023/5/15
CAN 1.75% 09/01/19	1.75	1,100	1,126	96,093	2019/9/1	DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,300	2,565	307,474	2024/5/15
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	900	944	80,592	2025/6/1	DBR 1.5% 09/04/22	1.5	500	552	66,224	2022/9/4
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,350	1,444	123,220	2024/6/1	DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,800	2,038	244,328	2024/2/15
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	1,500	1,620	138,183	2022/6/1	DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,500	2,791	334,541	2022/7/4
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,050	1,136	96,921	2048/12/1	DBR 2% 01/04/22	2.0	1,870	2,098	251,577	2022/1/4
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	350	389	33,190	2064/12/1	DBR 2% 08/15/23	2.0	1,350	1,545	185,301	2023/8/15
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,700	1,857	158,446	2021/6/1	DBR 2.25% 09/04/20	2.25	1,900	2,100	251,788	2020/9/4
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	2,640	2,862	244,131	2020/6/1	DBR 2.25% 09/04/21	2.25	4,300	4,851	581,536	2021/9/4
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,600	1,960	167,194	2045/12/1	DBR 2.5% 01/04/21	2.5	2,800	3,144	376,933	2021/1/4
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	2,090	2,232	190,409	2019/6/1	DBR 2.5% 07/04/44	2.5	1,770	2,351	281,860	2044/7/4
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,480	1,910	162,984	2041/6/1	DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,750	2,344	281,008	2046/8/15
CAN 4.25% 06/01/18	4.25	1,650	1,727	147,340	2018/6/1	DBR 3% 07/04/20	3.0	2,250	2,536	303,979	2020/7/4
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,200	1,711	145,962	2037/6/1	DBR 3.25% 01/04/20	3.25	2,250	2,515	301,522	2020/1/4
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,050	1,478	126,084	2029/6/1	DBR 3.25% 07/04/21	3.25	1,300	1,520	182,285	2021/7/4
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,180	1,747	149,045	2033/6/1	DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,450	2,152	257,985	2042/7/4
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	480	758	64,706	2027/6/1	DBR 3.5% 07/04/19	3.5	4,500	4,968	595,575	2019/7/4
小 計				3,509,703		DBR 3.75% 01/04/19	3.75	2,630	2,860	342,880	2019/1/4
(メキシコ) 国債証券		千メキシコ コペソ	千メキシコ コペソ			DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,150	3,373	404,333	2037/1/4
MBONO 10% 11/20/36	10.0	6,400	7,690	41,758	2036/11/20	DBR 4.25% 07/04/18	4.25	2,650	2,839	340,302	2018/7/4
MBONO 10% 12/05/24	10.0	28,900	33,397	181,347	2024/12/5	DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,320	2,193	262,861	2039/7/4
MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	25,400	24,766	134,482	2018/6/14	DBR 4.75% 07/04/28	4.75	800	1,183	141,838	2028/7/4
MBONO 5% 12/11/19	5.0	12,550	11,945	64,866	2019/12/11	DBR 4.75% 07/04/34	4.75	1,930	3,184	381,657	2034/7/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	3,150	2,804	15,227	2026/3/5	DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,420	2,535	303,941	2040/7/4
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	12,150	11,800	64,078	2022/6/9	DBR 5.5% 01/04/31	5.5	1,520	2,511	301,049	2031/1/4
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	25,850	25,315	137,462	2021/6/10	DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,500	2,338	280,280	2028/1/4
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	7,300	7,268	39,467	2027/6/3	DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,100	1,588	190,384	2024/1/4
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	14,600	14,482	78,637	2031/5/29	DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,000	1,713	205,371	2030/1/4
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	14,500	14,073	76,419	2042/11/13	DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,100	1,793	215,018	2027/7/4
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	8,250	8,094	43,954	2034/11/23	OBL 0% 04/17/20	-	1,050	1,074	128,736	2020/4/17
MBONO 8% 06/11/20	8.0	13,900	14,331	77,818	2020/6/11	OBL 0.25% 04/13/18	0.25	2,250	2,278	273,124	2018/4/13
MBONO 8% 12/07/23	8.0	11,750	12,181	66,146	2023/12/7	OBL 0.25% 10/16/20	0.25	1,800	1,859	222,873	2020/10/16
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	11,300	11,995	65,134	2029/5/31	OBL 0.5% 02/23/18	0.5	3,050	3,092	370,616	2018/2/23

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	
OBL 0.5% 04/12/19	0.5	850	874	104,801	2019/4/12	BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,250	2,715	325,503	2028/9/1		
OBL 1% 02/22/19	1.0	2,300	2,385	285,912	2019/2/22	BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,550	1,892	226,844	2044/9/1		
OBL 1% 10/12/18	1.0	1,450	1,494	179,104	2018/10/12	BTPS 5% 03/01/22	5.0	1,450	1,724	206,731	2022/3/1		
<b>(イタリア)</b>						BTPS 5% 03/01/25	5.0	2,300	2,800	335,657	2025/3/1		
<b>国債証券</b>						BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,800	3,554	426,027	2034/8/1		
BTPS 0.1% 04/15/19	0.1	400	399	47,833	2019/4/15	BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,100	2,641	316,654	2040/9/1		
BTPS 0.25% 05/15/18	0.25	1,200	1,205	144,463	2018/5/15	BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	1,740	2,206	264,437	2039/8/1		
BTPS 0.3% 10/15/18	0.3	1,300	1,305	156,524	2018/10/15	BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	2,600	3,299	395,529	2029/11/1		
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	1,650	1,547	185,515	2023/10/15	BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	3,500	4,287	513,895	2022/9/1		
BTPS 0.65% 11/01/20	0.65	1,200	1,204	144,428	2020/11/1	BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	3,350	4,111	492,772	2022/11/1		
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,800	1,626	194,998	2026/12/1	BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,350	3,187	382,095	2033/2/1		
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,350	1,361	163,220	2022/9/15	BTPS 6% 05/01/31	6.0	2,950	4,042	484,552	2031/5/1		
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,750	1,670	200,180	2025/6/1	BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,500	3,426	410,697	2027/11/1		
BTPS 1.5% 08/01/19	1.5	1,300	1,338	160,451	2019/8/1	BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	350	498	59,716	2026/11/1		
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,350	1,271	152,397	2026/6/1	BTPS 9% 11/01/23	9.0	1,800	2,639	316,330	2023/11/1		
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	450	391	46,929	2032/3/1	<b>(フランス)</b>							
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,000	1,964	235,456	2025/12/1	<b>国債証券</b>							
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	1,400	1,475	176,844	2021/12/15	FRTR 0% 02/25/19	-	500	505	60,605	2019/2/25		
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,320	1,175	140,919	2036/9/1	FRTR 0% 02/25/20	-	200	202	24,249	2020/2/25		
BTPS 2.5% 05/01/19	2.5	1,000	1,049	125,846	2019/5/1	FRTR 0% 05/25/20	-	1,500	1,517	181,893	2020/5/25		
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	1,800	1,864	223,513	2024/12/1	FRTR 0.25% 11/25/20	0.25	2,050	2,087	250,263	2020/11/25		
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	1,200	1,031	123,663	2047/3/1	FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	800	734	88,041	2026/11/25		
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	420	334	40,117	2067/3/1	FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	3,600	3,508	420,473	2025/5/25		
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,300	1,251	150,009	2046/9/1	FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	2,250	2,139	256,489	2026/5/25		
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	1,720	1,861	223,176	2030/3/1	FRTR 0.5% 11/25/19	0.5	1,000	1,026	123,057	2019/11/25		
BTPS 3.5% 06/01/18	3.5	150	157	18,819	2018/6/1	FRTR 1% 05/25/18	1.0	2,050	2,091	250,708	2018/5/25		
BTPS 3.5% 12/01/18	3.5	1,800	1,911	229,118	2018/12/1	FRTR 1% 05/25/19	1.0	1,630	1,687	202,214	2019/5/25		
BTPS 3.75% 03/01/21	3.75	3,250	3,650	437,531	2021/3/1	FRTR 1% 11/25/18	1.0	2,900	2,981	357,370	2018/11/25		
BTPS 3.75% 05/01/21	3.75	1,550	1,740	208,643	2021/5/1	FRTR 1% 11/25/25	1.0	2,240	2,250	269,732	2025/11/25		
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	2,400	2,705	324,247	2021/8/1	FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	1,900	1,710	205,068	2036/5/25		
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	1,900	2,139	256,499	2024/9/1	FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	1,950	1,932	231,618	2031/5/25		
BTPS 4% 02/01/37	4.0	2,400	2,706	324,388	2037/2/1	FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	2,600	2,827	338,848	2023/5/25		
BTPS 4% 09/01/20	4.0	2,870	3,221	386,069	2020/9/1	FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	400	323	38,779	2066/5/25		
BTPS 4.25% 02/01/19	4.25	3,250	3,514	421,261	2019/2/1	FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	2,550	2,755	330,299	2024/11/25		
BTPS 4.25% 03/01/20	4.25	2,600	2,902	347,840	2020/3/1	FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	3,440	3,854	461,992	2024/5/25		
BTPS 4.25% 09/01/19	4.25	4,350	4,785	573,584	2019/9/1	FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	3,050	3,405	408,191	2022/10/25		
BTPS 4.5% 02/01/18	4.5	2,400	2,510	300,866	2018/2/1	FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	3,150	3,540	424,314	2030/5/25		
BTPS 4.5% 02/01/20	4.5	2,250	2,523	302,413	2020/2/1	FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	4,250	4,688	561,922	2020/10/25		
BTPS 4.5% 03/01/19	4.5	4,250	4,626	554,551	2019/3/1	FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	3,400	3,913	469,088	2027/10/25		
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,410	2,839	340,365	2024/3/1	FRTR 3% 04/25/22	3.0	3,750	4,322	518,044	2022/4/25		
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,250	2,648	317,443	2026/3/1	FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	2,400	2,950	353,590	2045/5/25		
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	500	588	70,492	2023/5/1	FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	4,250	4,908	588,334	2021/10/25		
BTPS 4.5% 08/01/18	4.5	1,950	2,080	249,344	2018/8/1	FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	3,450	3,881	465,179	2020/4/25		
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	2,550	3,052	365,886	2023/8/1	FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	4,350	5,302	635,588	2026/4/25		
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	3,990	4,673	560,178	2021/9/1	FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	4,800	5,589	669,957	2021/4/25		

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 3.75% 10/25/19	3.75	3,550	3,957	474,391	2019/10/25	SPGB 2.75% 04/30/19	2.75	2,100	2,232	267,610	2019/4/30		
FRTR 4% 04/25/18	4.0	3,450	3,642	436,562	2018/4/25	SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	2,850	3,130	375,248	2024/10/31		
FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,470	2,115	253,599	2055/4/25	SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	860	828	99,314	2046/10/31		
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,150	1,672	200,509	2060/4/25	SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	450	445	53,396	2066/7/30		
FRTR 4% 10/25/38	4.0	2,300	3,153	377,964	2038/10/25	SPGB 3.75% 10/31/18	3.75	2,550	2,726	326,799	2018/10/31		
FRTR 4.25% 04/25/19	4.25	5,550	6,139	735,899	2019/4/25	SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,700	3,170	380,005	2024/4/30		
FRTR 4.25% 10/25/18	4.25	2,800	3,033	363,577	2018/10/25	SPGB 4% 04/30/20	4.0	2,050	2,305	276,332	2020/4/30		
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	3,900	4,893	586,584	2023/10/25	SPGB 4.1% 07/30/18	4.1	3,100	3,297	395,247	2018/7/30		
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,000	4,422	530,053	2041/4/25	SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,800	2,214	265,445	2037/1/31		
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	2,450	3,600	431,565	2035/4/25	SPGB 4.3% 10/31/19	4.3	2,400	2,678	321,022	2019/10/31		
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	2,650	3,891	466,482	2029/4/25	SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	1,850	2,248	269,519	2023/10/31		
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	2,700	4,260	510,628	2032/10/25	SPGB 4.5% 01/31/18	4.5	1,100	1,151	138,026	2018/1/31		
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	2,050	2,940	352,456	2025/10/25	SPGB 4.6% 07/30/19	4.6	2,600	2,896	347,204	2019/7/30		
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,800	2,705	324,255	2023/4/25	SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	1,850	2,301	275,856	2025/7/30		
FRTR 8.5% 10/25/19	8.5	1,350	1,680	201,430	2019/10/25	SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,450	1,908	228,733	2041/7/30		
<b>(オランダ)</b>						SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	1,400	1,740	208,660	2024/1/31		
<b>国債証券</b>						SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	2,200	2,576	308,833	2020/10/31		
NETHER 0.25% 01/15/20	0.25	1,500	1,538	184,404	2020/1/15	SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,350	1,819	218,060	2040/7/30		
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	1,120	1,105	132,539	2025/7/15	SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	1,300	1,724	206,711	2028/10/31		
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,550	1,540	184,665	2026/7/15	SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,070	1,495	179,255	2044/10/31		
NETHER 1.25% 01/15/19	1.25	610	632	75,863	2019/1/15	SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,450	3,099	371,515	2023/1/31		
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,770	1,972	236,367	2023/7/15	SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,000	3,652	437,741	2021/4/30		
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,600	1,814	217,474	2024/7/15	SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	1,850	2,662	319,121	2032/7/30		
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	1,800	2,044	245,060	2022/7/15	SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	2,000	2,517	301,739	2022/1/31		
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,220	1,504	180,276	2033/1/15	SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,850	2,516	301,603	2026/7/30		
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	650	890	106,727	2047/1/15	SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	2,100	2,977	356,939	2029/1/31		
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	1,300	1,514	181,538	2021/7/15	<b>(ベルギー)</b>							
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	1,720	1,962	235,208	2020/7/15	<b>国債証券</b>							
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	470	579	69,427	2023/1/15	BGB 0.8% 06/22/25	0.8	1,430	1,445	173,306	2025/6/22		
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,910	2,988	358,150	2042/1/15	BGB 0.8% 06/22/27	0.8	450	440	52,816	2027/6/22		
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,320	2,031	243,525	2037/1/15	BGB 1% 06/22/26	1.0	1,550	1,570	188,205	2026/6/22		
NETHER 4% 07/15/19	4.0	2,410	2,685	321,914	2019/7/15	BGB 1% 06/22/31	1.0	930	881	105,636	2031/6/22		
NETHER 4.0% 07/15/18	4.0	2,100	2,242	268,786	2018/7/15	BGB 1.25% 06/22/18	1.25	850	872	104,537	2018/6/22		
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,200	1,814	217,441	2028/1/15	BGB 1.6% 06/22/47	1.6	650	586	70,262	2047/6/22		
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	700	1,019	122,171	2023/1/15	BGB 1.9% 06/22/38	1.9	410	422	50,668	2038/6/22		
<b>(スペイン)</b>						BGB 2.15% 06/22/66	2.15	300	280	33,652	2066/6/22		
<b>国債証券</b>						BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,580	1,791	214,726	2023/6/22		
SPGB 0.25% 01/31/19	0.25	400	402	48,278	2019/1/31	BGB 2.6% 06/22/24	2.6	1,350	1,562	187,256	2024/6/22		
SPGB 0.75% 07/30/21	0.75	1,000	1,016	121,802	2021/7/30	BGB 3% 06/22/34	3.0	650	797	95,571	2034/6/22		
SPGB 1.15% 07/30/20	1.15	1,000	1,034	123,971	2020/7/30	BGB 3% 09/28/19	3.0	1,320	1,444	173,122	2019/9/28		
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	500	478	57,383	2026/10/31	BGB 3.75% 06/22/45	3.75	800	1,114	133,638	2045/6/22		
SPGB 1.4% 01/31/20	1.4	2,220	2,307	276,606	2020/1/31	BGB 3.75% 09/28/20	3.75	1,960	2,258	270,751	2020/9/28		
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,250	1,258	150,900	2025/4/30	BGB 4% 03/28/18	4.0	1,100	1,158	138,831	2018/3/28		
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	1,760	1,793	214,972	2026/4/30	BGB 4% 03/28/22	4.0	790	958	114,926	2022/3/28		
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,600	1,544	185,130	2030/7/30	BGB 4% 03/28/32	4.0	760	1,029	123,398	2032/3/28		
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,150	2,239	268,407	2025/10/31								

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	
BGB 4.0% 03/28/19	4.0	1,300	1,428	171,219	2023/9/28	IRISH 1% 05/15/26	1.0	570	559	67,046	2026/5/15		
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,580	2,343	280,945	2041/3/28	IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	370	348	41,750	2037/5/15		
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	1,500	1,814	217,447	2021/9/28	IRISH 2% 02/18/45	2.0	590	557	66,824	2045/2/18		
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	1,900	2,357	282,614	2022/9/28	IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	830	901	108,051	2030/5/15		
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	950	1,265	151,670	2026/3/28	IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	590	698	83,666	2024/3/18		
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,750	2,724	326,558	2035/3/28	IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	500	604	72,434	2023/3/20		
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	1,780	2,628	315,032	2028/3/28	IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	750	836	100,289	2019/6/18		
<b>(オーストリア)</b> <b>国債証券</b>						IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	1,100	1,265	151,737	2020/4/18		
RAGB 0% 07/15/23	-	150	149	17,901	2023/7/15	IRISH 4.5% 10/18/18	4.5	800	868	104,072	2018/10/18		
RAGB 0.25% 10/18/19	0.25	100	102	12,265	2019/10/18	IRISH 5% 10/18/20	5.0	800	954	114,354	2020/10/18		
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	600	606	72,661	2026/10/20	IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,300	1,745	209,244	2025/3/13		
RAGB 1.15% 10/19/18	1.15	420	432	51,884	2018/10/19	IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	700	817	98,013	2019/10/18		
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,350	1,435	172,105	2025/10/20	小 計				62,539,894			
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	800	884	106,045	2024/10/21	<b>(イギリス)</b> <b>国債証券</b>		千イギリスポンド	千イギリスポンド				
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	700	780	93,521	2023/10/20	UKT 1.25% 07/22/18	1.25	3,270	3,325	463,596	2018/7/22		
RAGB 1.95% 06/18/19	1.95	750	795	95,382	2019/6/18	UKT 1.5% 01/22/21	1.5	1,400	1,456	203,026	2021/1/22		
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	610	733	87,971	2034/5/23	UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,800	1,829	255,040	2026/7/22		
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	860	1,195	143,256	2044/6/20	UKT 1.5% 07/22/47	1.5	250	224	31,356	2047/7/22		
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	1,300	1,565	187,685	2022/11/22	UKT 1.75% 07/22/19	1.75	2,900	3,011	419,791	2019/7/22		
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,450	1,708	204,796	2021/9/15	UKT 1.75% 09/07/22	1.75	2,050	2,165	301,914	2022/9/7		
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	800	961	115,246	2022/4/20	UKT 1.75% 09/07/37	1.75	150	144	20,140	2037/9/7		
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	350	584	70,101	2062/1/26	UKT 2% 07/22/20	2.0	3,050	3,219	448,862	2020/7/22		
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	1,250	1,440	172,695	2020/7/15	UKT 2% 09/07/25	2.0	1,450	1,548	215,832	2025/9/7		
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,150	1,750	209,760	2037/3/15	UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,270	2,471	344,572	2023/9/7		
RAGB 4.35% 03/15/19	4.35	1,660	1,834	219,824	2019/3/15	UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,470	1,787	249,128	2065/7/22		
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	900	1,250	149,942	2026/3/15	UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,600	1,802	251,242	2024/9/7		
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	630	988	118,513	2027/7/15	UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,990	3,760	524,273	2044/1/22		
<b>(フィンランド)</b> <b>国債証券</b>						UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,150	1,516	211,446	2045/1/22		
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	490	486	58,270	2026/4/15	UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,720	2,675	373,029	2068/7/22		
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	390	375	45,044	2031/4/15	UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,480	2,188	305,068	2052/7/22		
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	250	258	31,014	2025/9/15	UKT 3.75% 09/07/19	3.75	850	928	129,461	2019/9/7		
RFGB 1.125% 09/15/18	1.125	550	565	67,833	2018/9/15	UKT 3.75% 09/07/20	3.75	1,920	2,154	300,278	2020/9/7		
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	770	841	100,916	2023/4/15	UKT 3.75% 09/07/21	3.75	1,050	1,203	167,767	2021/9/7		
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	380	417	50,080	2022/9/15	UKT 4% 01/22/60	4.0	1,340	2,205	307,397	2060/1/22		
RFGB 2% 04/15/24	2.0	390	440	52,795	2024/4/15	UKT 4% 03/07/22	4.0	2,050	2,400	334,660	2022/3/7		
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	460	591	70,899	2042/7/4	UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,000	2,754	383,978	2036/3/7		
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	530	647	77,559	2028/7/4	UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,450	1,939	270,431	2032/6/7		
RFGB 3.375% 04/15/20	3.375	900	1,013	121,435	2020/4/15	UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,600	2,264	315,607	2039/9/7		
RFGB 3.5% 04/15/21	3.5	1,000	1,164	139,562	2021/4/15	UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,050	1,348	188,038	2027/12/7		
RFGB 4% 07/04/25	4.0	580	755	90,573	2025/7/4	UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,600	2,289	319,184	2040/12/7		
RFGB 4.375% 07/04/19	4.375	300	336	40,341	2019/7/4	UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,950	2,946	410,683	2046/12/7		
<b>(アイルランド)</b> <b>国債証券</b>						UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,360	2,130	296,922	2049/12/7		
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	190	196	23,515	2022/3/15	UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,630	2,709	377,689	2055/12/7		
						UKT 4.5% 03/07/19	4.5	2,100	2,292	319,516	2019/3/7		

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
		千円	外貨建金額	千円	外貨換算金額				千円	外貨建金額	千円	外貨換算金額	
	%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円				%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円		
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,180	3,062	425,552	2034/9/7	(ポーランド) 国債証券		—	700	677	18,905	2018/10/25	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	1,940	2,931	408,589	2042/12/7	POLGB 0% 10/25/18		1.5	1,450	1,406	39,270	2020/4/25	
UKT 4.75% 03/07/20	4.75	2,390	2,720	379,224	2020/3/7	POLGB 1.5% 04/25/20		1.75	2,050	1,952	54,503	2021/7/25	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,350	1,868	260,510	2030/12/7	POLGB 2% 04/25/21		2.0	2,860	2,765	77,210	2021/4/25	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,350	2,026	282,438	2038/12/7	POLGB 2.25% 04/25/22		2.25	600	575	16,063	2022/4/25	
UKT 5% 03/07/18	5.0	1,000	1,052	146,787	2018/3/7	POLGB 2.5% 07/25/18		2.5	3,720	3,756	104,871	2018/7/25	
UKT 5% 03/07/25	5.0	2,070	2,697	376,080	2025/3/7	POLGB 2.5% 07/25/26		2.5	3,150	2,864	79,968	2026/7/25	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,050	1,569	218,789	2028/12/7	POLGB 2.5% 07/25/27		2.5	550	491	13,716	2027/7/25	
UKT 8% 06/07/21	8.0	1,300	1,721	239,939	2021/6/7	POLGB 3.25% 07/25/19		3.25	3,150	3,225	90,053	2019/7/25	
小 計				11,477,854		POLGB 3.25% 07/25/25		3.25	3,050	2,979	83,200	2025/7/25	
(スイス) 国債証券		千スイスフラン	千スイスフラン			POLGB 3.75% 04/25/18		3.75	2,100	2,152	60,091	2018/4/25	
SWISS 2% 04/28/21	2.0	250	279	31,460	2021/4/28	POLGB 4% 10/25/23		4.0	2,870	2,977	83,128	2023/10/25	
SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	570	631	71,084	2020/7/6	POLGB 5.25% 10/25/20		5.25	1,940	2,117	59,129	2020/10/25	
SWISS 3% 05/12/19	3.0	550	599	67,542	2019/5/12	POLGB 5.5% 10/25/19		5.5	2,200	2,383	66,541	2019/10/25	
SWISS 4% 02/11/23	4.0	380	484	54,585	2023/2/11	POLGB 5.75% 04/25/29		5.75	1,150	1,369	38,231	2029/4/25	
SWISS 4% 04/08/28	4.0	550	799	90,018	2028/4/8	POLGB 5.75% 09/23/22		5.75	1,800	2,034	56,808	2022/9/23	
小 計				314,692		POLGB 5.75% 10/25/21		5.75	2,270	2,548	71,166	2021/10/25	
(スウェーデン) 国債証券		千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ			小 計					1,012,860		
SGB 1% 11/12/26	1.0	4,960	5,098	64,445	2026/11/12	(オーストラリア) 国債証券			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	7,750	8,383	105,967	2023/11/13	ACGB 1.75% 11/21/20	1.75	1,750	1,732	147,842	2020/11/21		
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	6,100	7,093	89,664	2025/5/12	ACGB 2% 12/21/21	2.0	1,400	1,388	118,508	2021/12/21		
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	4,690	6,262	79,161	2039/3/30	ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,400	1,321	112,780	2028/5/21		
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	9,500	11,240	142,073	2022/6/1	ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,670	2,715	231,744	2024/4/21		
SGB 4.25% 03/12/19	4.25	8,950	9,858	124,610	2019/3/12	ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	550	503	43,004	2035/6/21		
SGB 5% 12/01/20	5.0	9,150	10,991	138,929	2020/12/1	ACGB 2.75% 10/21/19	2.75	1,550	1,585	135,357	2019/10/21		
小 計				744,852		ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,750	1,744	148,877	2027/11/21		
(ノルウェー) 国債証券		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ			ACGB 3% 03/21/47	3.0	700	602	51,427	2047/3/21		
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	2,900	2,864	38,702	2026/2/19	ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,680	2,809	239,768	2025/4/21		
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	3,490	3,544	47,888	2025/3/13	ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,230	1,272	108,593	2029/4/21		
NGB 2% 05/24/23	2.0	4,650	4,848	65,505	2023/5/24	ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	50	47	4,058	2039/6/21		
NGB 3% 03/14/24	3.0	5,490	6,080	82,147	2024/3/14	ACGB 3.25% 10/21/18	3.25	1,050	1,075	91,835	2018/10/21		
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	7,400	8,255	111,535	2021/5/25	ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,130	1,178	100,613	2037/4/21		
NGB 4.5% 05/22/19	4.5	7,050	7,663	103,538	2019/5/22	ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	3,100	3,501	298,815	2026/4/21		
小 計				449,318		ACGB 4.5% 04/15/20	4.5	2,900	3,129	267,086	2020/4/15		
(デンマーク) 国債証券		千デンマーククローネ	千デンマーククローネ			ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,100	1,285	109,678	2033/4/21		
DGB 0.25% 11/15/18	0.25	3,310	3,361	54,185	2018/11/15	ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,620	3,091	263,889	2027/4/21		
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,050	7,753	124,989	2023/11/15	ACGB 5.25% 03/15/19	5.25	3,010	3,222	275,042	2019/3/15		
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	6,650	7,433	119,833	2025/11/15	ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	2,000	2,362	201,618	2023/4/21		
DGB 3% 11/15/21	3.0	9,150	10,590	170,722	2021/11/15	ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	2,250	2,585	220,677	2021/5/15		
DGB 4% 11/15/19	4.0	8,670	9,773	157,550	2019/11/15	ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	1,800	2,122	181,123	2022/7/15		
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	11,900	19,974	321,986	2039/11/15	小 計					3,352,346		
小 計				949,267		(シンガポール) 国債証券			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
						SIGB 0.5% 04/01/18	0.5	350	348	27,545	2018/4/1		

当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		外貨建金額	千シンガポールドル	外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
SIGB 1.25% 10/01/21	1.25	140	137	10,894		2021/10/1
SIGB 1.625% 10/01/19	1.625	310	313	24,773		2019/10/1
SIGB 2% 07/01/20	2.0	100	101	8,065		2020/7/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	200	197	15,658		2026/6/1
SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	720	738	58,435		2021/6/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	150	151	12,023		2025/6/1
SIGB 2.5% 06/01/19	2.5	800	824	65,190		2019/6/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	230	234	18,535		2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	400	407	32,254		2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	370	387	30,669		2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	200	208	16,505		2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	370	384	30,430		2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24	3.0	590	626	49,529		2024/9/1
SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	500	535	42,329		2022/9/1
SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	620	658	52,106		2020/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	270	297	23,548		2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	520	573	45,382		2027/3/1
SIGB 4% 09/01/18	4.0	700	732	57,906		2018/9/1
小 計				621,786		
<b>(マレーシア) 国債証券</b>						
		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
MGS 3.26% 03/01/18	3.26	1,200	1,201	30,317		2018/3/1
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	1,950	1,907	48,137		2022/8/15
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	1,600	1,561	39,395		2023/3/15
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	2,040	2,036	51,387		2020/3/31
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	670	624	15,745		2027/5/31
MGS 3.58% 09/28/18	3.58	1,800	1,809	45,655		2018/9/28
MGS 3.62% 11/30/21	3.62	950	949	23,958		2021/11/30
MGS 3.759% 03/15/19	3.759	200	201	5,088		2019/3/15
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	630	568	14,354		2033/4/15
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,350	1,365	34,446		2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	640	617	15,567		2027/3/15
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	1,080	1,016	25,654		2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	2,000	2,040	51,483		2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	2,800	2,824	71,274		2024/7/15
MGS 4.24% 02/07/18	4.24	330	333	8,415		2018/2/7
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	2,800	2,870	72,419		2019/11/29
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,650	1,673	42,218		2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	2,350	2,339	59,024		2030/4/15

当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		外貨建金額	千マレーシアリンギット	外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	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 4.935% 09/30/43	4.935	1,120	1,133	28,593		2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	950	1,017	25,668		2028/9/15
小 計				708,805		
<b>(南アフリカ) 国債証券</b>						
		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	18,100	20,077	168,247		2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	10,300	7,401	62,025		2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	9,250	6,625	55,518		2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	5,550	5,285	44,295		2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	8,840	7,298	61,160		2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	6,350	6,237	52,269		2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	4,700	4,551	38,143		2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	6,300	5,723	47,965		2030/1/31
SAGB 8% 12/21/18	8.0	4,750	4,767	39,952		2018/12/21
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	4,950	4,513	37,823		2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	6,300	5,711	47,860		2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	7,150	6,567	55,038		2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	12,800	11,731	98,306		2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	2,800	2,654	22,240		2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	4,500	4,263	35,725		2040/1/31
小 計				866,572		
合 計				158,766,026		

(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		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外 国	EURO-SCHATZ	百万円	百万円
	US 5YR NOTE	175	—
	EURO-BOBL FU	303	—
	EURO-BUND	224	—
	US 10YR NOTE	391	—
	US LONG BOND	195	—
		118	—

(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	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	158,766,026	97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,093,455	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	162,859,481	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(160,439,924千円)の投資信託財産総額(162,859,481千円)に対する比率は98.5%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=111.75円	1カナダドル=85.29円	1メキシコペソ=5.43円
1ユーロ=119.86円	1イギリスポンド=139.40円	1スイスフラン=112.58円
1スウェーデンクローナ=12.64円	1ノルウェークローネ=13.51円	1デンマーククローネ=16.12円
1ポーランドズロチ=27.92円	1オーストラリアドル=85.35円	1シンガポールドル=79.10円
1マレーシアリンギット=25.23円	1南アフリカランド=8.38円	

## 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 2017年2月7日現在
(A) 資 産	164,815,622,387円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,502,742,185
公 社 債(評価額)	158,766,026,848
未 収 入 金	1,961,901,726
未 収 利 息	1,425,711,185
前 払 費 用	48,353,484
差 入 委 託 証 拠 金	110,886,959
(B) 負 債	2,218,758,915
未 払 金	2,034,708,454
未 払 解 約 金	184,047,248
未 払 利 息	3,180
そ の 他 未 払 費 用	33
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	162,596,863,472
元 本	73,249,993,117
次 期 繰 越 損 益 金	89,346,870,355
(D) 受 益 権 総 口 数	73,249,993,117口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,198円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年2月9日 至 2017年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	4,278,045,699円
受 取 利 息	4,280,089,989
支 払 利 息	△2,044,290
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△17,361,050,355
売 買 益	1,168,131,153
売 買 損	△18,529,181,508
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	7,028,917
取 引 益	93,935,333
取 引 損	△86,906,416
(D) そ の 他 費 用	△21,329,245
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△13,097,304,984
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	105,926,745,618
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	14,068,375,469
(H) 解 約 差 損 益 金	△17,550,945,748
(I) 計 (E+F+G+H)	89,346,870,355
次 期 繰 越 損 益 金(I)	89,346,870,355

(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まず。

(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。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は75,888,868,174円、期中追加設定元本額は11,387,550,903円、期中一部解約元本額は14,026,425,960円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC外国債券インデックスファンドL	10,661,373,240円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	10,109,582,342円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	8,249,898,392円
外国債券バッシブファンド私募A (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	4,249,864,214円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	4,167,201,966円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	3,245,615,084円
私募外国債券バッシブファンド (適格機関投資家専用)	3,193,434,440円
外国債券インデックスファンド	2,720,633,380円
インデックスコレクション (外国債券)	2,700,027,787円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	2,610,388,214円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	2,415,345,493円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	2,220,557,989円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	2,156,228,154円
DC外国債券インデックスファンド	1,818,348,668円
外国債券インデックスe	1,620,873,543円
外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	1,526,114,521円
インデックスコレクション (バランス株式30)	1,395,791,247円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	1,117,106,218円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	991,271,892円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	759,323,418円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	758,866,771円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	616,886,470円
DCバランスファンド50	611,669,507円
DCバランスファンド30	606,822,560円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	462,165,949円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	451,876,630円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	406,231,247円
インデックスコレクション (バランス株式50)	265,115,143円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	191,044,814円
VAバランス株式40 (適格機関投資家専用)	176,559,930円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	155,002,645円
バランスVA20 (適格機関投資家専用)	140,346,026円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	125,019,817円
DCバランスファンド70	116,635,110円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	75,177,238円
インデックスコレクション (バランス株式70)	71,400,496円
物価連動債組入世界債券ファンド	28,686,046円
私募外国債券インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	24,222,813円
バランスVA20L (適格機関投資家専用)	20,097,948円
VAバランス株式30 (適格機関投資家専用)	17,091,932円
世界バランスVA20 (適格機関投資家専用)	93,823円

## お知らせ

該当事項はありません。