

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6期(決算日 2016年2月8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	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率			
第2期(2012年2月7日)	円 8,855	円 0	% △0.4	281.993	% 0.6	% 97.5	% 1.0	百万円 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
第6期(2016年2月8日)	14,062	0	△2.3	459.396	△2.1	97.7	0.9	4,059

(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	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2015年 2月 9日	14,389	—	469.338	—	96.8	1.6
2月末	14,399	0.1	469.431	0.0	98.1	0.5
3月末	14,345	△0.3	465.962	△0.7	97.2	1.0
4月末	14,333	△0.4	467.467	△0.4	96.2	1.8
5月末	14,619	1.6	477.014	1.6	97.8	0.6
6月末	14,404	0.1	468.925	△0.1	97.0	1.2
7月末	14,583	1.3	475.956	1.4	96.6	1.4
8月末	14,349	△0.3	467.181	△0.5	96.5	1.7
9月末	14,306	△0.6	465.877	△0.7	97.2	1.1
10月末	14,307	△0.6	467.317	△0.4	96.4	1.8
11月末	14,292	△0.7	467.104	△0.5	97.8	0.8
12月末	14,087	△2.1	459.321	△2.1	98.3	0.3
2016年 1月末	14,302	△0.6	459.284	△2.1	97.4	1.1
(当期末)						
2016年 2月 8日	14,062	△2.3	459.396	△2.1	97.7	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。

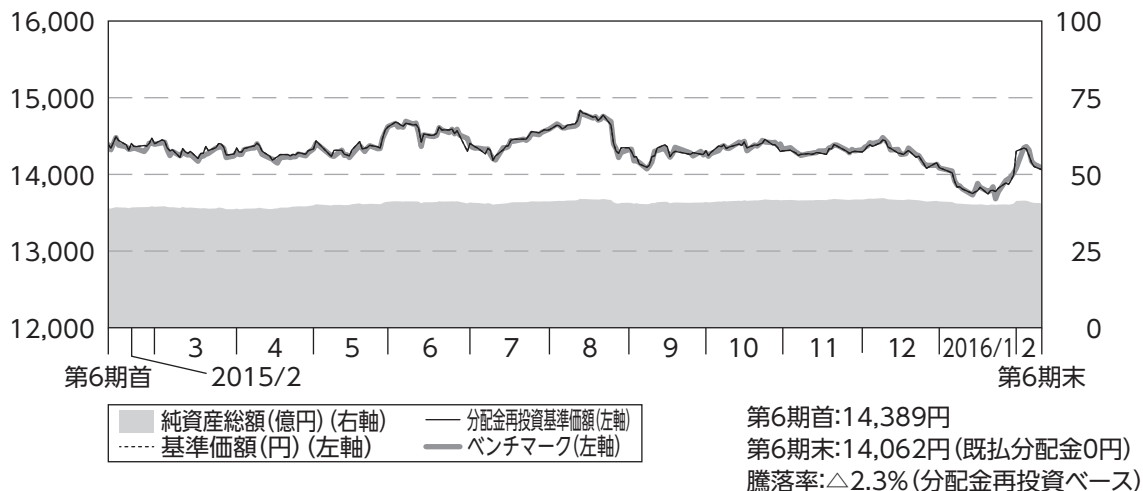
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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

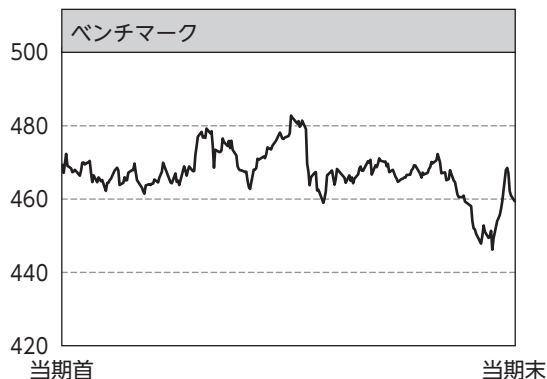


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2015年2月9日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

基準価額は、ウクライナ停戦合意などが金利上昇(債券価格は下落)要因となった一方で、ECB(欧州中央銀行)の量的金融緩和開始などが金利低下(債券価格は上昇)要因となったことから、期初はもみ合い推移となりました。6月から7月上旬にかけてギリシャの債務不履行懸念を背景に基準価額は乱高下した後、円安推移となったことから一旦上昇しましたが、8月中旬には世界的に株価が急落したことを受けて円高となり、下落しました。その後12月上旬にかけて、基準価額はもみ合い推移となりました。12月中旬以降は、世界経済の減速懸念などを背景にリスク回避姿勢が強まったことを受けて円高が進行し、基準価額は下落基調を強めました。1月末に日銀がマイナス金利政策導入を決定すると為替が円安方向に転じたために、一旦上昇しました。しかし、世界経済の先行き不透明感は根強く、再度円高圧力が強まったことから、期末にかけて基準価額は下落しました。

投資環境



主要国の長期金利は、FRB(米連邦準備理事会)による利上げ観測の強まりを受けて上昇圧力がかかる場面もありましたが、世界経済の先行き不透明感の高まりや原油価格の下落を背景としたインフレ率の低下を受けて、期末にかけて金利低下圧力が強まりました。

外国為替市場では、期の前半は米国の利上げ観測を背景として欧米金利が上昇する局面で円安傾向となりましたが、期末にかけて世界経済の減速懸念や原油価格の急落を受けてリスク回避姿勢が強まると、円高推移となりました。

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。

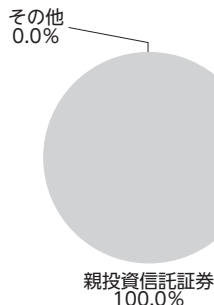
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

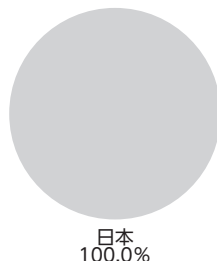
	当期末
	2016年2月8日
外国債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

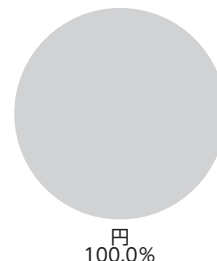
○資産別配分



○国別配分



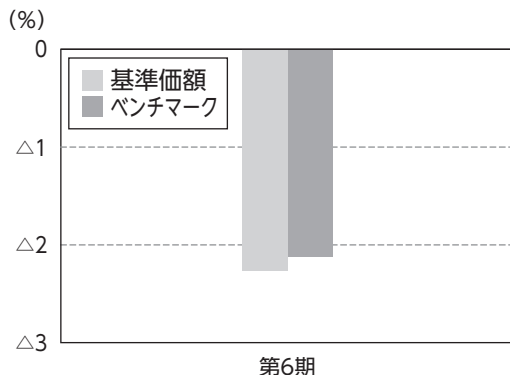
○通貨別配分



(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とベンチマークの騰落率の対比です。



(注)基準価額の騰落率は分配金込みです。

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^(※1)、債券の価格評価差^(※2)等です。

(※1)当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。

(※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6期	
	2015年2月10日～2016年2月8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)	4,593	

(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
	(2015年2月10日～2016年2月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	77円	0.539%	(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14,360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)	(29)	(0.205)	
(販売会社)	(42)	(0.291)	
(受託会社)	(6)	(0.043)	
(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	80	0.560	

(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
	千口	千円	千口	千円
外国債券マザーファンド	233,666	569,714	134,997	326,584

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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
コール・ローン	2,793	159	5.7	2,797	157	5.6

(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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	111,285	111,285	100.0	114,395	114,395	100.0
為替直物取引	1,332	1,249	93.8	66,319	65,989	99.5
コール・ローン	994,925	43,602	4.4	998,563	43,310	4.3

<平均保有割合 1.9%>

(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
	千口		千口	千円
外国債券マザーファンド	1,595,860		1,694,529	4,059,752

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、75,888,868千口です。

※ 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	4,059,752	99.7
コール・ローン等、その他	13,980	0.3
投資信託財産総額	4,073,732	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(179,517,129千円)の投資信託財産総額(181,981,361千円)に対する比率は98.6%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=117.02円、1カナダドル=84.21円、1メキシコペソ=6.35円、1ユーロ=130.37円、1イギリスポンド=169.84円、1スイスフラン=117.87円、1スウェーデンクローナ=13.83円、1ノルウェークローネ=13.66円、1デンマーククローネ=17.47円、1ポーランドズロチ=29.55円、1オーストラリアドル=83.04円、1シンガポールドル=83.19円、1マレーシアリンギット=28.07円、1南アフリカランド=7.31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 2016年2月8日現在
(A) 資 産	4,073,732,912円
コール・ローン等	13,444,649
外国債券マザーファンド(評価額)	4,059,752,702
未 収 入 金	535,545
未 収 利 息	16
(B) 負 債	13,813,877
未 払 解 約 金	2,541,871
未 払 信 託 報 酬	11,160,462
そ の 他 未 払 費 用	111,544
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,059,919,035
元 本	2,887,070,320
次 期 繰 越 損 益 金	1,172,848,715
(D) 受 益 権 総 口 数	2,887,070,320口
1万口当たり基準価額(C/D)	14.062円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年2月10日 至 2016年2月 8日
(A) 配 当 等 収 益	6,183円
受 取 利 息	6,183
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△68,500,477
売 買 益	6,913,032
売 買 損	△75,413,509
(C) 信 託 報 酬 等	△22,100,421
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△90,594,715
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	458,059,462
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	805,383,968
(配 当 等 相 当 額)	(780,785,913)
(売 買 損 益 相 当 額)	(24,598,055)
(G) 計 (D+E+F)	1,172,848,715
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	1,172,848,715
追 加 信 託 差 損 益 金	805,383,968
(配 当 等 相 当 額)	(781,657,292)
(売 買 損 益 相 当 額)	(23,726,676)
分 配 準 備 積 立 金	544,534,803
繰 越 損 益 金	△177,070,056

(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2,704,217,300円、期中追加設定元本額は906,175,524円、期中一部解約元本額は723,322,504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)	86,475,341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	781,657,292円
(D) 分配準備積立金額	458,059,462円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	1,326,192,095円
(F) 期末残存口数	2,887,070,320口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	4,593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

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」の一部改正及び「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2015年5月9日)

外国債券マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2016年2月8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
第15期(2016年2月8日)	23,958	△1.7	459.396	△2.1	97.7	0.9	181,815

(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) 2015年 2月 9日	24,380	—	469.338	—	96.8	1.6
2月末	24,403	0.1	469.431	0.0	98.1	0.5
3月末	24,324	△0.2	465.962	△0.7	97.2	1.0
4月末	24,315	△0.3	467.467	△0.4	96.2	1.8
5月末	24,811	1.8	477.014	1.6	97.8	0.6
6月末	24,457	0.3	468.925	△0.1	97.0	1.2
7月末	24,773	1.6	475.956	1.4	96.7	1.4
8月末	24,386	0.0	467.181	△0.5	96.5	1.7
9月末	24,325	△0.2	465.877	△0.7	97.2	1.1
10月末	24,338	△0.2	467.317	△0.4	96.4	1.8
11月末	24,324	△0.2	467.104	△0.5	97.9	0.8
12月末	23,986	△1.6	459.321	△2.1	98.3	0.3
2016年 1月末	24,362	△0.1	459.284	△2.1	97.4	1.1
(当 期 末) 2016年 2月 8日	23,958	△1.7	459.396	△2.1	97.7	0.9

(注1)騰落率は期首比です。

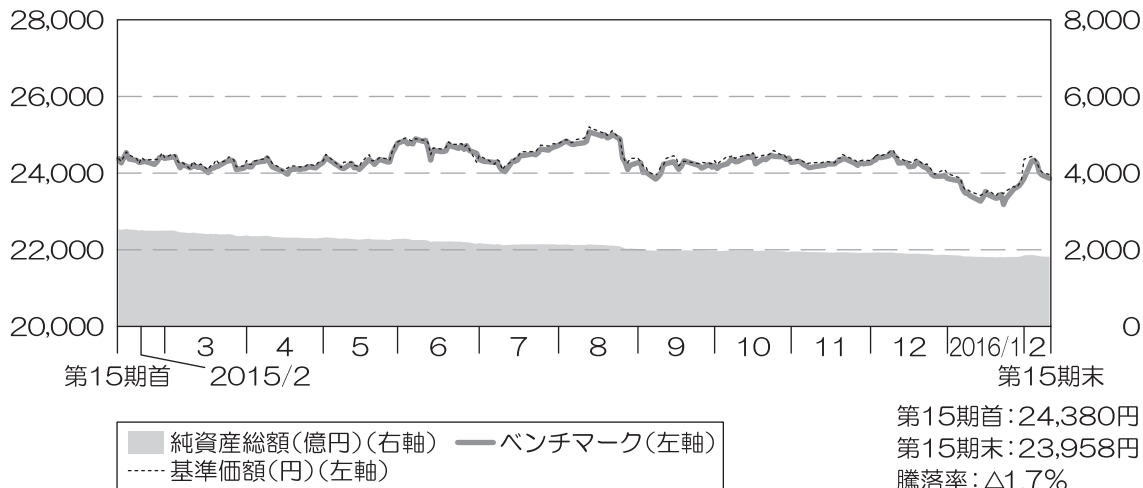
(注2)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

ベンチマークは、シティ世界国債インデックス(除く日本、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

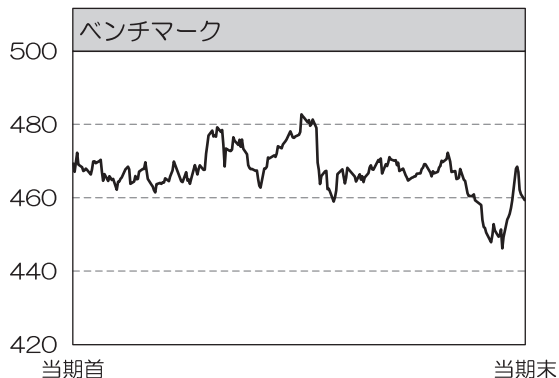


(注)ベンチマークは2015年2月9日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

基準価額は、ウクライナ停戦合意などが金利上昇(債券価格は下落)要因となった一方で、ECB(欧州中央銀行)の量的金融緩和開始などが金利低下(債券価格は上昇)要因となったことから、期初はもみ合い推移となりました。6月から7月上旬にかけてギリシャの債務不履行懸念を背景に基準価額は乱高下した後、円安推移となったことから一旦上昇しましたが、8月中旬には世界的に株価が急落したことを受けて円高となり、下落しました。その後12月上旬にかけて、基準価額はもみ合い推移となりました。12月中旬以降は、世界経済の減速懸念などを背景にリスク回避姿勢が強まったことを受けて円高が進行し、基準価額は下落基調を強めました。1月末に日銀がマイナス金利政策導入を決定すると為替が円安方向に転じたために、一旦上昇しました。しかし、世界経済の先行き不透明感は根強く、再度円高圧力が強まったことから、期末にかけて基準価額は下落しました。

投資環境



主要国の長期金利は、FRB(米連邦準備理事会)による利上げ観測の強まりを受けて上昇圧力がかかる場面もありましたが、世界経済の先行き不透明感の高まりや原油価格の下落を背景としたインフレ率の低下を受けて、期末にかけて金利低下圧力が強まりました。

外国為替市場では、期の前半は米国の利上げ観測を背景として欧米金利が上昇する局面で円安傾向となりましたが、期末にかけて世界経済の減速懸念や原油価格の急落を受けてリスク回避姿勢が強まると、円高推移となりました。

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

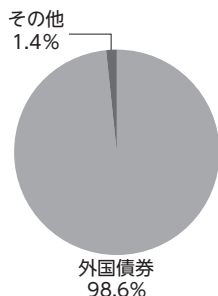
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	T 2% 08/15/25	アメリカ	0.7%
2	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	0.7%
3	T 2.5% 02/15/45	アメリカ	0.6%
4	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	0.6%
5	T 1.25% 11/15/18	アメリカ	0.6%
6	T 2.75% 11/15/23	アメリカ	0.6%

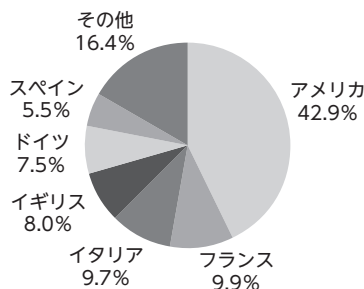
順位	銘柄名	国	組入比率
7	T 3.125% 08/15/44	アメリカ	0.5%
8	T 1.375% 04/30/20	アメリカ	0.5%
9	T 3.625% 02/15/44	アメリカ	0.5%
10	T 2.875% 05/15/43	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		640	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

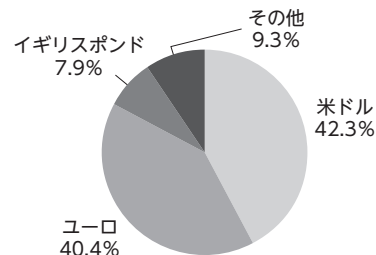
○資産別配分



○国別配分



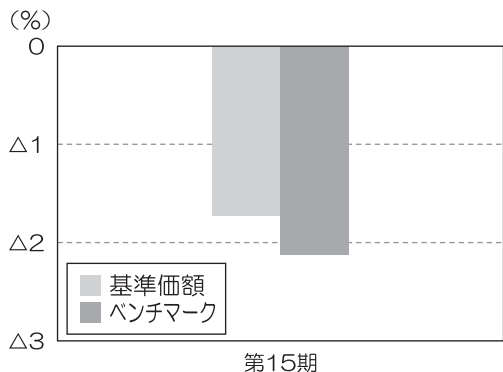
○通貨別配分



(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^(※1)と債券の価格評価差^(※2)等です。

(※1) 当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。

(※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
	(2015年2月10日～2016年2月8日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.002%	$(a) \text{ 売買委託手数料} = \frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	-	-	$(b) \text{ 有価証券取引税} = \frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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)	(-)	(-)	
(c) その他費用	3	0.013	$(c) \text{ その他費用} = \frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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、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(24,400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 116,411	千米ドル 313,131
	カ ナ ダ	国債証券	千カナダドル 7,352	千カナダドル 22,946
	メ キ シ コ	国債証券	千メキシコペソ 29,561	千メキシコペソ 92,967
	ド イ ツ	国債証券	千ユーロ 7,170	千ユーロ 47,654
	イ タ リ ア	国債証券	14,332	58,005
	フ ラ ン ス	国債証券	14,367	56,656
	オ ラ ン ダ	国債証券	2,841	16,111
	ス ペ イ ン	国債証券	8,825	30,207
	ベ ル ギ ー	国債証券	3,347	14,781
	オ ー ス ト リ ア	国債証券	898	8,061
	フ ィ ン ラ ン ド	国債証券	1,086	3,888
	ア イ ル ラ ン ド	国債証券	1,136	4,852
国	イ ギ リ ス	国債証券	千イギリスポンド 9,566	千イギリスポンド 37,716
	ス イ ス	国債証券	千スイスフラン -	千スイスフラン 2,577
	ス ウ ェ ー デ ン	国債証券	千スウェーデンクローナ 4,891	千スウェーデンクローナ 24,907
	ノ ル ウ ェ ー	国債証券	千ノルウェークローネ 2,910	千ノルウェークローネ 9,268
	デ ン マ ー ク	国債証券	千デンマーククローネ 777	千デンマーククローネ 32,285
	ポ ー ラ ン ド	国債証券	千ポーランドズロチ 4,680	千ポーランドズロチ 13,746
	オ ー ス ト ラ リ ア	国債証券	千オーストラリアドル 3,653	千オーストラリアドル 9,459
	シ ン ガ ポ ー ル	国債証券	千シンガポールドル 1,112	千シンガポールドル 3,817
	マ レ ー シ ア	国債証券	千マレーシアリンギット 3,847	千マレーシアリンギット 11,999
	南 ア フ リ カ	国債証券	千南アフリカランド 13,283	千南アフリカランド 35,381

(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 55,360	百万円 57,693	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	$\frac{D}{C}$ %
為 替 先 物 取 引	百万円 111,285	百万円 111,285	100.0	百万円 114,395	百万円 114,395	100.0
為 替 直 物 取 引	1,332	1,249	93.8	66,319	65,989	99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン	994,925	43,602	4.4	998,563	43,310	4.3

(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 621,740	千米ドル 652,729	千円 76,382,449	% 42.0	% —	% 17.1	% 16.1	% 8.8
カ ナ ダ	千カナダドル 36,730	千カナダドル 42,419	3,572,120	2.0	—	1.0	0.6	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 230,500	千メキシコペソ 256,429	1,628,325	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 84,750	千ユーロ 102,513	13,364,644	7.4	—	4.2	2.2	0.9
イ タ リ ア	108,860	132,801	17,313,277	9.5	—	6.1	2.3	1.2
フ ラ ン ス	110,010	134,217	17,497,978	9.6	—	6.0	2.8	0.9
オ ラ ン ダ	27,610	33,666	4,389,089	2.4	—	1.4	0.6	0.4
ス ペ イ ン	63,910	75,344	9,822,656	5.4	—	3.1	1.6	0.8
ベ ル ギ ー	28,360	35,637	4,646,073	2.6	—	1.8	0.5	0.3
オ ー ス ト リ ア	17,620	21,629	2,819,872	1.6	—	1.0	0.4	0.2
フ ィ ン ラ ン ド	7,470	8,557	1,115,662	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ア イ ル ラ ン ド	9,340	11,126	1,450,551	0.8	—	0.4	0.4	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 68,900	千イギリスポンド 84,068	14,278,188	7.9	—	5.6	1.9	0.4
ス イ ス	千スイスフラン 3,690	千スイスフラン 4,423	521,408	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 52,350	千スウェーデンクローナ 61,190	846,260	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 33,250	千ノルウェークローネ 36,564	499,467	0.3	—	0.2	0.1	0.0
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 50,320	千デンマーククローネ 65,244	1,139,823	0.6	—	0.5	0.1	0.1
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 31,000	千ポーランドズロチ 33,397	986,885	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 34,260	千オーストラリアドル 37,728	3,133,006	1.7	—	1.0	0.4	0.3
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 7,470	千シンガポールドル 7,836	651,938	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 29,290	千マレーシアリンギット 29,611	831,205	0.5	—	0.2	0.2	0.0
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド 107,940	千南アフリカランド 96,739	707,163	0.4	—	0.3	0.0	0.0
合 計	—	—	177,598,047	97.7	—	51.5	31.2	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		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		%	千米ドル	千米ドル	千円		
(アメリカ)											
国債証券											
T 0.5% 07/31/17	0.5	7,010	6,988	817,746	2017/7/31	T 1.375% 10/31/20	1.375	6,000	6,037	706,521	2020/10/31
T 0.625% 02/15/17	0.625	1,000	999	117,001	2017/2/15	T 1.375% 11/30/18	1.375	3,000	3,040	355,818	2018/11/30
T 0.625% 04/30/18	0.625	2,850	2,839	332,223	2018/4/30	T 1.375% 12/31/18	1.375	3,700	3,750	438,834	2018/12/31
T 0.625% 05/31/17	0.625	3,000	2,997	350,724	2017/5/31	T 1.5% 01/31/19	1.5	1,900	1,932	226,129	2019/1/31
T 0.625% 08/31/17	0.625	2,500	2,496	292,098	2017/8/31	T 1.5% 01/31/22	1.5	5,000	5,014	586,791	2022/1/31
T 0.625% 09/30/17	0.625	3,250	3,244	379,676	2017/9/30	T 1.5% 02/28/19	1.5	2,300	2,338	273,698	2019/2/28
T 0.625% 11/30/17	0.625	5,000	4,989	583,842	2017/11/30	T 1.5% 05/31/19	1.5	1,350	1,372	160,578	2019/5/31
T 0.75% 02/28/18	0.75	4,500	4,498	526,404	2018/2/28	T 1.5% 08/31/18	1.5	2,500	2,542	297,481	2018/8/31
T 0.75% 03/31/18	0.75	5,000	4,997	584,814	2018/3/31	T 1.5% 10/31/19	1.5	3,200	3,248	380,146	2019/10/31
T 0.75% 06/30/17	0.75	4,000	4,002	468,399	2017/6/30	T 1.5% 11/30/19	1.5	5,000	5,074	593,865	2019/11/30
T 0.75% 10/31/17	0.75	1,600	1,600	187,268	2017/10/31	T 1.5% 12/31/18	1.5	2,500	2,542	297,532	2018/12/31
T 0.75% 12/31/17	0.75	5,000	5,000	585,100	2017/12/31	T 1.625% 03/31/19	1.625	4,400	4,490	525,517	2019/3/31
T 0.875% 01/31/18	0.875	2,000	2,004	234,547	2018/1/31	T 1.625% 04/30/19	1.625	4,000	4,083	477,798	2019/4/30
T 0.875% 02/28/17	0.875	6,000	6,014	703,834	2017/2/28	T 1.625% 06/30/19	1.625	4,000	4,082	477,679	2019/6/30
T 0.875% 04/15/17	0.875	5,000	5,012	586,608	2017/4/15	T 1.625% 07/31/19	1.625	3,500	3,571	417,921	2019/7/31
T 0.875% 04/30/17	0.875	3,350	3,358	393,004	2017/4/30	T 1.625% 08/15/22	1.625	1,400	1,410	165,085	2022/8/15
T 0.875% 05/15/17	0.875	6,000	6,014	703,834	2017/5/15	T 1.625% 11/15/22	1.625	4,000	4,019	470,365	2022/11/15
T 0.875% 06/15/17	0.875	4,550	4,561	533,751	2017/6/15	T 1.75% 02/28/22	1.75	3,650	3,711	434,297	2022/2/28
T 0.875% 07/15/17	0.875	4,000	4,009	469,231	2017/7/15	T 1.75% 05/15/22	1.75	4,600	4,671	546,618	2022/5/15
T 0.875% 07/31/19	0.875	5,000	4,972	581,865	2019/7/31	T 1.75% 05/15/23	1.75	1,750	1,766	206,696	2023/5/15
T 0.875% 10/15/18	0.875	6,000	6,001	702,284	2018/10/15	T 1.75% 10/31/18	1.75	1,800	1,842	215,642	2018/10/31
T 1% 03/31/17	1.0	5,000	5,019	587,419	2017/3/31	T 1.875% 05/31/22	1.875	7,250	7,413	867,566	2022/5/31
T 1% 05/31/18	1.0	1,000	1,004	117,511	2018/5/31	T 1.875% 06/30/20	1.875	3,200	3,293	385,383	2020/6/30
T 1% 06/30/19	1.0	1,200	1,199	140,410	2019/6/30	T 1.875% 08/31/17	1.875	2,000	2,035	238,213	2017/8/31
T 1% 08/31/19	1.0	2,800	2,795	327,112	2019/8/31	T 1.875% 08/31/22	1.875	2,600	2,655	310,723	2022/8/31
T 1% 09/15/17	1.0	4,100	4,118	481,890	2017/9/15	T 1.875% 09/30/17	1.875	1,210	1,232	144,240	2017/9/30
T 1% 09/15/18	1.0	2,350	2,358	276,012	2018/9/15	T 1.875% 10/31/17	1.875	4,900	4,994	584,485	2017/10/31
T 1% 09/30/19	1.0	5,000	4,987	583,637	2019/9/30	T 1.875% 11/30/21	1.875	3,500	3,588	419,977	2021/11/30
T 1% 11/30/19	1.0	6,100	6,077	711,173	2019/11/30	T 2% 02/15/22	2.0	3,100	3,201	374,693	2022/2/15
T 1% 12/15/17	1.0	6,000	6,029	705,520	2017/12/15	T 2% 02/15/23	2.0	6,500	6,687	782,557	2023/2/15
T 1.125% 03/31/20	1.125	2,000	1,998	233,843	2020/3/31	T 2% 02/15/25	2.0	3,500	3,555	416,017	2025/2/15
T 1.125% 05/31/19	1.125	2,850	2,862	335,018	2019/5/31	T 2% 02/28/21	2.0	1,550	1,602	187,509	2021/2/28
T 1.125% 06/15/18	1.125	1,900	1,913	223,957	2018/6/15	T 2% 05/31/21	2.0	3,000	3,100	362,812	2021/5/31
T 1.125% 12/31/19	1.125	5,200	5,202	608,741	2019/12/31	T 2% 07/31/20	2.0	4,000	4,135	483,914	2020/7/31
T 1.25% 01/31/19	1.25	4,800	4,846	567,192	2019/1/31	T 2% 07/31/22	2.0	6,000	6,174	722,552	2022/7/31
T 1.25% 01/31/20	1.25	4,000	4,018	470,246	2020/1/31	T 2% 08/15/25	2.0	11,150	11,307	1,323,248	2025/8/15
T 1.25% 04/30/19	1.25	2,000	2,017	236,110	2019/4/30	T 2% 08/31/21	2.0	4,200	4,337	507,562	2021/8/31
T 1.25% 11/15/18	1.25	9,000	9,090	1,063,711	2018/11/15	T 2% 11/15/21	2.0	4,300	4,438	519,431	2021/11/15
T 1.25% 12/15/18	1.25	5,500	5,555	650,083	2018/12/15	T 2% 11/30/20	2.0	2,800	2,894	338,733	2020/11/30
T 1.375% 02/28/19	1.375	5,500	5,571	651,994	2019/2/28	T 2% 11/30/22	2.0	500	514	60,163	2022/11/30
T 1.375% 04/30/20	1.375	8,250	8,319	973,504	2020/4/30	T 2.125% 01/31/21	2.125	5,000	5,200	608,606	2021/1/31
T 1.375% 05/31/20	1.375	5,000	5,039	589,762	2020/5/31	T 2.125% 05/15/25	2.125	5,250	5,387	630,397	2025/5/15
T 1.375% 06/30/18	1.375	3,500	3,547	415,089	2018/6/30	T 2.125% 06/30/21	2.125	3,000	3,119	365,061	2021/6/30
T 1.375% 07/31/18	1.375	3,000	3,040	355,811	2018/7/31	T 2.125% 08/15/21	2.125	2,900	3,015	352,892	2021/8/15
T 1.375% 09/30/18	1.375	2,520	2,554	298,916	2018/9/30	T 2.125% 08/31/20	2.125	1,000	1,039	121,609	2020/8/31
T 1.375% 09/30/20	1.375	5,200	5,234	612,521	2020/9/30	T 2.125% 12/31/22	2.125	5,950	6,168	721,807	2022/12/31

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	
	%	千円	千円	千円	千円		%	千円	千円	千円	千円		
T 2.25% 03/31/21	2.25	3,000	3,138	367,241	2021/3/31	T 3.625% 02/15/20	3.625	9,800	10,755	1,258,608	2020/2/15		
T 2.25% 04/30/21	2.25	4,700	4,918	575,506	2021/4/30	T 3.625% 02/15/21	3.625	2,100	2,336	273,392	2021/2/15		
T 2.25% 07/31/18	2.25	1,500	1,552	181,724	2018/7/31	T 3.625% 02/15/44	3.625	6,500	7,803	913,142	2044/2/15		
T 2.25% 07/31/21	2.25	4,500	4,709	551,057	2021/7/31	T 3.625% 08/15/19	3.625	5,500	5,992	701,208	2019/8/15		
T 2.25% 11/15/24	2.25	5,000	5,188	607,178	2024/11/15	T 3.625% 08/15/43	3.625	3,200	3,845	450,000	2043/8/15		
T 2.25% 11/30/17	2.25	2,000	2,053	240,316	2017/11/30	T 3.75% 08/15/41	3.75	1,100	1,343	157,186	2041/8/15		
T 2.375% 05/31/18	2.375	1,500	1,553	181,807	2018/5/31	T 3.75% 11/15/18	3.75	2,000	2,158	252,539	2018/11/15		
T 2.375% 06/30/18	2.375	2,500	2,593	303,537	2018/6/30	T 3.75% 11/15/43	3.75	1,400	1,720	201,345	2043/11/15		
T 2.375% 07/31/17	2.375	2,000	2,048	239,767	2017/7/31	T 3.875% 05/15/18	3.875	1,150	1,230	143,951	2018/5/15		
T 2.375% 08/15/24	2.375	6,700	7,028	822,424	2024/8/15	T 3.875% 08/15/40	3.875	950	1,179	138,066	2040/8/15		
T 2.375% 12/31/20	2.375	7,200	7,572	886,185	2020/12/31	T 4.0% 08/15/18	4.0	300	324	37,943	2018/8/15		
T 2.5% 02/15/45	2.5	10,350	9,952	1,164,626	2045/2/15	T 4.25% 05/15/39	4.25	1,750	2,294	268,448	2039/5/15		
T 2.5% 05/15/24	2.5	5,800	6,146	719,306	2024/5/15	T 4.25% 11/15/17	4.25	1,350	1,432	167,659	2017/11/15		
T 2.5% 06/30/17	2.5	3,200	3,279	383,789	2017/6/30	T 4.25% 11/15/40	4.25	2,000	2,624	307,159	2040/11/15		
T 2.5% 08/15/23	2.5	5,000	5,311	621,565	2023/8/15	T 4.375% 02/15/38	4.375	700	935	109,515	2038/2/15		
T 2.625% 01/31/18	2.625	4,300	4,457	521,593	2018/1/31	T 4.375% 05/15/40	4.375	1,600	2,135	249,907	2040/5/15		
T 2.625% 04/30/18	2.625	3,600	3,744	438,172	2018/4/30	T 4.375% 05/15/41	4.375	1,350	1,806	211,448	2041/5/15		
T 2.625% 08/15/20	2.625	5,000	5,306	620,914	2020/8/15	T 4.375% 11/15/39	4.375	1,950	2,600	304,311	2039/11/15		
T 2.625% 11/15/20	2.625	2,350	2,496	292,087	2020/11/15	T 4.5% 02/15/36	4.5	600	814	95,282	2036/2/15		
T 2.75% 02/15/19	2.75	2,000	2,108	246,747	2019/2/15	T 4.5% 05/15/17	4.5	3,500	3,668	429,264	2017/5/15		
T 2.75% 02/15/24	2.75	9,000	9,715	1,136,899	2024/2/15	T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,360	159,190	2038/5/15		
T 2.75% 02/28/18	2.75	290	301	35,301	2018/2/28	T 4.5% 08/15/39	4.5	1,250	1,696	198,479	2039/8/15		
T 2.75% 05/31/17	2.75	4,900	5,031	588,808	2017/5/31	T 4.625% 02/15/17	4.625	1,000	1,040	121,737	2017/2/15		
T 2.75% 08/15/42	2.75	3,150	3,218	376,611	2042/8/15	T 4.625% 02/15/40	4.625	1,500	2,071	242,371	2040/2/15		
T 2.75% 11/15/23	2.75	7,950	8,588	1,004,969	2023/11/15	T 4.75% 02/15/41	4.75	2,300	3,239	379,122	2041/2/15		
T 2.75% 11/15/42	2.75	2,900	2,957	346,072	2042/11/15	T 4.75% 08/15/17	4.75	3,000	3,183	372,576	2017/8/15		
T 2.75% 12/31/17	2.75	5,300	5,498	643,403	2017/12/31	T 5.0% 05/15/37	5.0	1,150	1,666	195,057	2037/5/15		
T 2.875% 03/31/18	2.875	2,550	2,662	311,543	2018/3/31	T 5.25% 02/15/29	5.25	500	682	79,871	2029/2/15		
T 2.875% 05/15/43	2.875	7,300	7,609	890,518	2043/5/15	T 5.25% 11/15/28	5.25	1,350	1,837	215,002	2028/11/15		
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,200	2,284	267,349	2045/8/15	T 5.375% 02/15/31	5.375	1,900	2,697	315,685	2031/2/15		
T 3% 02/28/17	3.0	4,600	4,713	551,602	2017/2/28	T 5.5% 08/15/28	5.5	250	346	40,509	2028/8/15		
T 3% 05/15/42	3.0	2,450	2,631	307,882	2042/5/15	T 6.0% 02/15/26	6.0	600	827	96,839	2026/2/15		
T 3% 05/15/45	3.0	1,000	1,064	124,564	2045/5/15	T 6.125% 11/15/27	6.125	1,050	1,508	176,567	2027/11/15		
T 3% 11/15/44	3.0	2,050	2,184	255,601	2044/11/15	T 6.25% 05/15/30	6.25	1,200	1,815	212,479	2030/5/15		
T 3.125% 02/15/42	3.125	800	880	103,032	2042/2/15	T 6.25% 08/15/23	6.25	2,500	3,323	388,862	2023/8/15		
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,600	2,846	333,096	2043/2/15	T 6.5% 11/15/26	6.5	450	651	76,236	2026/11/15		
T 3.125% 04/30/17	3.125	4,900	5,046	590,543	2017/4/30	T 8.0% 11/15/21	8.0	2,600	3,552	415,672	2021/11/15		
T 3.125% 05/15/19	3.125	3,620	3,871	453,008	2019/5/15	T 8.75% 05/15/17	8.75	2,700	2,976	348,283	2017/5/15		
T 3.125% 05/15/21	3.125	4,190	4,569	534,738	2021/5/15	T 8.75% 08/15/20	8.75	1,800	2,396	280,392	2020/8/15		
T 3.125% 08/15/44	3.125	7,700	8,413	984,507	2044/8/15	小 計				76,382,449			
T 3.125% 11/15/41	3.125	3,200	3,523	412,327	2041/11/15	(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル				
T 3.25% 03/31/17	3.25	5,000	5,146	602,253	2017/3/31	CAN 0.25% 05/01/17	0.25	350	349	29,425	2017/5/1		
T 3.375% 05/15/44	3.375	1,500	1,718	201,132	2044/5/15	CAN 0.25% 11/01/17	0.25	420	419	35,290	2017/11/1		
T 3.375% 11/15/19	3.375	5,900	6,399	748,847	2019/11/15	CAN 1.25% 02/01/18	1.25	700	712	59,964	2018/2/1		
T 3.5% 02/15/18	3.5	3,650	3,849	450,439	2018/2/15	CAN 1.25% 03/01/18	1.25	1,700	1,730	145,715	2018/3/1		
T 3.5% 02/15/39	3.5	1,600	1,884	220,483	2039/2/15	CAN 1.25% 08/01/17	1.25	400	405	34,117	2017/8/1		
T 3.5% 05/15/20	3.5	4,050	4,438	519,398	2020/5/15	CAN 1.25% 09/01/18	1.25	1,050	1,073	90,387	2018/9/1		

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	
	%	千カナダドル	千カナダドル	千円		%	千ユーロ	千ユーロ	千円
CAN 1.5% 02/01/17	1.5	2,250	2,273	191,481	2017/2/1	(ドイツ) 国債証券			
CAN 1.5% 03/01/17	1.5	600	606	51,107	2017/3/1	BKO 0% 06/16/17	—	1,700	1,711
CAN 1.5% 03/01/20	1.5	250	260	21,961	2020/3/1	DBR 0.5% 02/15/26	0.5	300	306
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,750	1,823	153,545	2023/6/1	DBR 1% 08/15/24	1.0	1,800	1,941
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	500	512	43,121	2026/6/1	DBR 1% 08/15/25	1.0	1,250	1,342
CAN 1.5% 09/01/17	1.5	2,400	2,441	205,628	2017/9/1	DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,850	3,174
CAN 1.75% 03/01/19	1.75	1,150	1,197	100,870	2019/3/1	DBR 1.5% 05/15/23	1.5	3,450	3,849
CAN 1.75% 09/01/19	1.75	700	733	61,733	2019/9/1	DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,750	3,083
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	900	989	83,291	2025/6/1	DBR 1.5% 09/04/22	1.5	1,600	1,775
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,350	1,509	127,093	2024/6/1	DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,800	2,052
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	1,050	1,178	99,231	2022/6/1	DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,450	2,753
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	490	580	48,922	2048/12/1	DBR 2% 01/04/22	2.0	2,200	2,489
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	400	503	42,424	2064/12/1	DBR 2% 08/15/23	2.0	1,800	2,079
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,950	2,218	186,855	2021/6/1	DBR 2.25% 09/04/20	2.25	1,400	1,568
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	2,640	2,984	251,323	2020/6/1	DBR 2.25% 09/04/21	2.25	1,950	2,223
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,800	2,429	204,580	2045/12/1	DBR 2.5% 01/04/21	2.5	2,650	3,017
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	2,750	3,051	256,965	2019/6/1	DBR 2.5% 07/04/44	2.5	1,530	2,116
CAN 4% 06/01/17	4.0	1,750	1,832	154,326	2017/6/1	DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,000	1,393
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,680	2,361	198,869	2041/6/1	DBR 3% 07/04/20	3.0	2,950	3,389
CAN 4.25% 06/01/18	4.25	1,650	1,796	151,299	2018/6/1	DBR 3.25% 01/04/20	3.25	2,050	2,345
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,350	2,072	174,495	2037/6/1	DBR 3.25% 07/04/21	3.25	1,050	1,250
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	850	1,279	107,785	2029/6/1	DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,800	2,772
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,250	1,987	167,377	2033/6/1	DBR 3.5% 07/04/19	3.5	4,010	4,551
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	650	1,103	92,925	2027/6/1	DBR 3.75% 01/04/19	3.75	2,630	2,954
小 計				3,572,120		DBR 4.0% 01/04/18	4.0	2,550	2,770
(メキシコ) 国債証券		千メキシ コペソ	千メキシ コペソ			DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,300	3,678
MBONO 10% 11/20/36	10.0	6,400	8,677	55,101	2036/11/20	DBR 4.25% 07/04/17	4.25	2,750	2,933
MBONO 10% 12/05/24	10.0	22,800	29,277	185,909	2024/12/5	DBR 4.25% 07/04/18	4.25	1,100	1,226
MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	25,400	25,684	163,098	2018/6/14	DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,250	2,132
MBONO 5% 06/15/17	5.0	15,000	15,266	96,943	2017/6/15	DBR 4.75% 07/04/28	4.75	800	1,218
MBONO 5% 12/11/19	5.0	8,350	8,366	53,129	2019/12/11	DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,000	3,372
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	1,350	1,318	8,372	2026/3/5	DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,650	3,037
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	10,400	10,909	69,274	2022/6/9	DBR 5.5% 01/04/31	5.5	1,530	2,596
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	17,700	18,662	118,505	2021/6/10	DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,800	2,896
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	7,300	8,061	51,190	2027/6/3	DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,100	1,647
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	18,850	20,978	133,213	2031/5/29	DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,000	1,772
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	13,950	15,456	98,146	2042/11/13	DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,100	1,857
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	1,900	2,114	13,430	2034/11/23	OBL 0% 04/17/20	—	1,050	1,066
MBONO 7.75% 12/14/17	7.75	11,600	12,424	78,894	2017/12/14	OBL 0.25% 04/13/18	0.25	2,250	2,287
MBONO 8% 06/11/20	8.0	20,050	22,303	141,624	2020/6/11	OBL 0.25% 10/16/20	0.25	1,800	1,848
MBONO 8% 12/07/23	8.0	9,850	11,199	71,114	2023/12/7	OBL 0.5% 02/23/18	0.5	3,050	3,112
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	11,900	14,161	89,922	2029/5/31	OBL 0.5% 04/07/17	0.5	2,450	2,477
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	10,950	13,060	82,936	2038/11/18	OBL 0.5% 04/12/19	0.5	850	875
MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	16,750	18,506	117,518	2018/12/13	OBL 0.5% 10/13/17	0.5	1,700	1,728
小 計				1,628,325		OBL 0.75% 02/24/17	0.75	750	759
						OBL 1% 02/22/19	1.0	1,500	1,566
						OBL 1% 10/12/18	1.0	1,450	1,508

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	
(イタリア)						(フランス)							
国債証券						国債証券							
BTPS 0.25% 05/15/18	0.25	1,200	1,206	157,241	2018/5/15	BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,900	4,334	565,067	2027/11/1		
BTPS 0.3% 10/15/18	0.3	1,300	1,308	170,575	2018/10/15	BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	350	542	70,692	2026/11/1		
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,700	1,754	228,672	2022/9/15	BTPS 9% 11/01/23	9.0	1,800	2,835	369,728	2023/11/1		
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,750	1,757	229,147	2025/6/1	(フランス)							
BTPS 1.5% 08/01/19	1.5	850	888	115,785	2019/8/1	国債証券							
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	700	754	98,407	2021/12/15	BTNS 1% 07/25/17	1.0	2,800	2,858	372,681	2017/7/25		
BTPS 2.5% 05/01/19	2.5	1,000	1,075	140,212	2019/5/1	BTNS 1.75% 02/25/17	1.75	950	971	126,651	2017/2/25		
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	1,300	1,417	184,744	2024/12/1	FRTR 0% 02/25/19	—	500	505	65,856	2019/2/25		
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,150	1,282	167,253	2046/9/1	FRTR 0% 05/25/20	—	1,500	1,512	197,214	2020/5/25		
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	1,300	1,543	201,192	2030/3/1	FRTR 0.25% 11/25/20	0.25	950	967	126,170	2020/11/25		
BTPS 3.5% 06/01/18	3.5	150	162	21,120	2018/6/1	FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	3,550	3,538	461,272	2025/5/25		
BTPS 3.5% 11/01/17	3.5	2,900	3,076	401,095	2017/11/1	FRTR 0.5% 11/25/19	0.5	1,500	1,543	201,221	2019/11/25		
BTPS 3.5% 12/01/18	3.5	1,800	1,972	257,217	2018/12/1	FRTR 1% 05/25/18	1.0	2,400	2,478	323,100	2018/5/25		
BTPS 3.75% 03/01/21	3.75	550	637	83,075	2021/3/1	FRTR 1% 05/25/19	1.0	3,100	3,234	421,743	2019/5/25		
BTPS 3.75% 05/01/21	3.75	1,350	1,567	204,369	2021/5/1	FRTR 1% 11/25/18	1.0	2,900	3,011	392,632	2018/11/25		
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	3,700	4,310	561,899	2021/8/1	FRTR 1% 11/25/25	1.0	1,100	1,139	148,611	2025/11/25		
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,400	2,857	372,507	2024/9/1	FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	700	734	95,742	2031/5/25		
BTPS 4% 02/01/17	4.0	1,050	1,091	142,338	2017/2/1	FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	2,500	2,779	362,365	2023/5/25		
BTPS 4% 02/01/37	4.0	2,800	3,519	458,901	2037/2/1	FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	2,550	2,836	369,848	2024/11/25		
BTPS 4% 09/01/20	4.0	2,750	3,193	416,319	2020/9/1	FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	3,100	3,578	466,551	2024/5/25		
BTPS 4.25% 02/01/19	4.25	4,350	4,887	637,190	2019/2/1	FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	2,350	2,684	350,024	2022/10/25		
BTPS 4.25% 03/01/20	4.25	3,800	4,403	574,026	2020/3/1	FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	2,650	3,154	411,202	2030/5/25		
BTPS 4.25% 09/01/19	4.25	3,150	3,599	469,251	2019/9/1	FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	3,150	3,545	462,191	2020/10/25		
BTPS 4.5% 02/01/18	4.5	4,400	4,790	624,594	2018/2/1	FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,250	5,150	671,474	2027/10/25		
BTPS 4.5% 02/01/20	4.5	2,600	3,032	395,385	2020/2/1	FRTR 3% 04/25/22	3.0	3,750	4,440	578,879	2022/4/25		
BTPS 4.5% 03/01/19	4.5	3,350	3,797	495,140	2019/3/1	FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	1,850	2,541	331,391	2045/5/25		
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,900	3,611	470,855	2024/3/1	FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	4,250	5,046	657,952	2021/10/25		
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,250	2,862	373,164	2026/3/1	FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	4,950	5,729	746,903	2020/4/25		
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	100	123	16,142	2023/5/1	FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	2,050	2,627	342,503	2026/4/25		
BTPS 4.5% 08/01/18	4.5	1,950	2,164	282,237	2018/8/1	FRTR 3.75% 04/25/17	3.75	3,160	3,319	432,821	2017/4/25		
BTPS 4.75% 05/01/17	4.75	260	275	35,887	2017/5/1	FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	3,600	4,323	563,634	2021/4/25		
BTPS 4.75% 06/01/17	4.75	4,700	4,994	651,166	2017/6/1	FRTR 3.75% 10/25/19	3.75	3,250	3,737	487,215	2019/10/25		
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	2,850	3,592	468,337	2023/8/1	FRTR 4% 04/25/18	4.0	3,450	3,789	493,982	2018/4/25		
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	3,550	4,332	564,817	2021/9/1	FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,470	2,398	312,670	2055/4/25		
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,050	2,710	353,310	2028/9/1	FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,150	1,903	248,176	2060/4/25		
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,700	2,405	313,555	2044/9/1	FRTR 4% 10/25/38	4.0	2,300	3,421	446,103	2038/10/25		
BTPS 5% 03/01/22	5.0	3,200	3,986	519,765	2022/3/1	FRTR 4.25% 04/25/19	4.25	3,400	3,902	508,767	2019/4/25		
BTPS 5% 03/01/25	5.0	3,800	4,945	644,736	2025/3/1	FRTR 4.25% 10/25/17	4.25	4,550	4,915	640,893	2017/10/25		
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,750	3,876	505,429	2034/8/1	FRTR 4.25% 10/25/18	4.25	2,800	3,153	411,143	2018/10/25		
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,100	3,008	392,259	2040/9/1	FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	4,550	5,940	774,433	2023/10/25		
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	1,700	2,446	318,888	2039/8/1	FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	2,600	4,222	550,431	2041/4/25		
BTPS 5.25% 08/01/17	5.25	1,750	1,886	245,990	2017/8/1	FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	2,450	3,875	505,206	2035/4/25		
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,100	4,323	563,649	2029/11/1	FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	3,530	5,526	720,498	2029/4/25		
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	1,500	1,934	252,137	2022/9/1	FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	3,000	5,085	662,974	2032/10/25		
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	3,350	4,329	564,444	2022/11/1	FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	2,250	3,419	445,759	2025/10/25		
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	1,700	2,559	333,629	2033/2/1	FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,800	2,879	375,403	2023/4/25		
BTPS 6% 05/01/31	6.0	3,200	4,830	629,716	2031/5/1	FRTR 8.5% 10/25/19	8.5	1,350	1,792	233,673	2019/10/25		

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	千円	外貨建金額	邦貨換算金額	
(オランダ)						(ベルギー)							
国債証券						国債証券							
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	550	541	70,640	2025/7/15	SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,050	1,511	197,027	2044/10/31		
NETHER 0.5% 04/15/17	0.5	1,850	1,871	243,952	2017/4/15	SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	1,900	2,446	318,964	2023/1/31		
NETHER 1.25% 01/15/18	1.25	1,350	1,395	181,891	2018/1/15	SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	1,800	2,245	292,681	2021/4/30		
NETHER 1.25% 01/15/19	1.25	1,700	1,783	232,574	2019/1/15	SPGB 5.5% 07/30/17	5.5	2,750	2,973	387,695	2017/7/30		
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,500	1,683	219,428	2023/7/15	SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	1,700	2,499	325,844	2032/7/30		
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,600	1,834	239,212	2024/7/15	SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	2,700	3,484	454,318	2022/1/31		
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	1,800	2,066	269,404	2022/7/15	SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	300	418	54,525	2026/7/30		
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,450	1,817	236,952	2033/1/15	SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	2,920	4,223	550,646	2029/1/31		
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	450	638	83,299	2047/1/15	(オーストリア)							
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	200	237	30,922	2021/7/15	国債証券							
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	1,570	1,834	239,187	2020/7/15	BGB 0.8% 06/22/25	0.8	1,430	1,457	189,984	2025/6/22		
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	1,620	2,039	265,945	2023/1/15	BGB 1% 06/22/26	1.0	350	358	46,801	2026/6/22		
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,100	3,391	442,104	2042/1/15	BGB 1.25% 06/22/18	1.25	850	883	115,245	2018/6/22		
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,420	2,232	291,101	2037/1/15	BGB 1.9% 06/22/38	1.9	410	439	57,330	2038/6/22		
NETHER 4% 07/15/19	4.0	2,300	2,648	345,252	2019/7/15	BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,650	1,896	247,206	2023/6/22		
NETHER 4.0% 07/15/18	4.0	2,100	2,328	303,602	2018/7/15	BGB 2.6% 06/22/24	2.6	1,350	1,593	207,738	2024/6/22		
NETHER 4.5% 07/15/17	4.5	2,000	2,143	279,399	2017/7/15	BGB 3% 06/22/34	3.0	650	828	108,064	2034/6/22		
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,350	2,113	275,493	2028/1/15	BGB 3% 09/28/19	3.0	1,150	1,288	168,405	2019/9/28		
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	700	1,064	138,724	2023/1/15	BGB 3.5% 06/28/17	3.5	1,450	1,528	199,329	2017/6/28		
(スペイン)						(オーストリア)							
国債証券						国債証券							
SPGB 0.25% 01/31/19	0.25	400	400	52,253	2019/1/31	BGB 3.75% 09/28/20	3.75	1,850	2,190	285,637	2020/9/28		
SPGB 1.15% 07/30/20	1.15	1,200	1,233	160,851	2020/7/30	BGB 4% 03/28/18	4.0	1,150	1,259	164,219	2018/3/28		
SPGB 1.4% 01/31/20	1.4	1,050	1,091	142,322	2020/1/31	BGB 4% 03/28/22	4.0	790	983	128,233	2022/3/28		
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,050	1,054	137,538	2025/4/30	BGB 4% 03/28/32	4.0	950	1,341	174,940	2032/3/28		
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	1,100	1,122	146,305	2026/4/30	BGB 4.0% 03/28/17	4.0	500	525	68,453	2017/3/28		
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	950	921	120,104	2030/7/30	BGB 4.0% 03/28/19	4.0	1,450	1,649	215,027	2019/3/28		
SPGB 2.1% 04/30/17	2.1	2,300	2,360	307,722	2017/4/30	BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,580	2,488	324,446	2041/3/28		
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,350	2,456	320,309	2025/10/31	BGB 4.25% 09/28/21	4.25	1,750	2,176	283,715	2021/9/28		
SPGB 2.75% 04/30/19	2.75	2,100	2,270	295,999	2019/4/30	BGB 4.25% 09/28/22	4.25	1,900	2,423	315,894	2022/9/28		
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	2,700	2,971	387,330	2024/10/31	BGB 4.5% 03/28/26	4.5	950	1,310	170,849	2026/3/28		
SPGB 3.75% 10/31/18	3.75	2,550	2,802	365,350	2018/10/31	BGB 5% 03/28/35	5.0	2,050	3,328	433,998	2035/3/28		
SPGB 3.8% 01/31/17	3.8	2,530	2,625	342,297	2017/1/31	BGB 5.5% 03/28/28	5.5	1,850	2,838	370,073	2028/3/28		
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,900	3,431	447,341	2024/4/30	BGB 5.5% 09/28/17	5.5	1,500	1,646	214,623	2017/9/28		
SPGB 4% 04/30/20	4.0	2,050	2,352	306,708	2020/4/30	(オーストリア)							
SPGB 4.1% 07/30/18	4.1	2,600	2,856	372,409	2018/7/30	国債証券							
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,650	2,063	269,050	2037/1/31	RAGB 1.15% 10/19/18	1.15	800	834	108,737	2018/10/19		
SPGB 4.3% 10/31/19	4.3	2,400	2,752	358,868	2019/10/31	RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	450	477	62,238	2025/10/20		
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	1,760	2,163	282,103	2023/10/31	RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	800	887	115,690	2024/10/21		
SPGB 4.5% 01/31/18	4.5	2,450	2,665	347,498	2018/1/31	RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	700	782	102,021	2023/10/20		
SPGB 4.6% 07/30/19	4.6	3,300	3,795	494,762	2019/7/30	RAGB 1.95% 06/18/19	1.95	750	807	105,328	2019/6/18		
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	1,850	2,344	305,642	2025/7/30	RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	500	602	78,516	2034/5/23		
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,500	2,011	262,219	2041/7/30	RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	650	925	120,664	2044/6/20		
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	1,400	1,766	230,310	2024/1/31	RAGB 3.2% 02/20/17	3.2	720	746	97,378	2017/2/20		
SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	1,850	2,218	289,261	2020/10/31	RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	1,320	1,618	211,032	2022/11/22		
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,400	1,923	250,754	2040/7/30	RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,750	2,105	274,542	2021/9/15		
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	1,400	1,884	245,637	2028/10/31	RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	800	982	128,095	2022/4/20		
						RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	400	707	92,264	2062/1/26		
						RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	1,150	1,362	177,669	2020/7/15		

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	千イギリスポンド	千イギリスポンド	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,200	1,852	241,519	2037/3/15	UKT 2.5% 07/22/65	2.5	440	476	80,863	2065/7/22		
RAGB 4.3% 09/15/17	4.3	1,050	1,130	147,350	2017/9/15	UKT 2.75% 09/07/24	2.75	2,350	2,594	440,722	2024/9/7		
RAGB 4.35% 03/15/19	4.35	1,800	2,064	269,133	2019/3/15	UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,750	3,248	551,723	2044/1/22		
RAGB 4.65% 01/15/18	4.65	1,100	1,209	157,649	2018/1/15	UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,150	1,423	241,762	2045/1/22		
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	900	1,276	166,400	2026/3/15	UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,000	2,781	472,467	2068/7/22		
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	780	1,255	163,637	2027/7/15	UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,480	2,022	343,477	2052/7/22		
(フィンランド) 国債証券						UKT 3.75% 09/07/19	3.75	850	943	160,291	2019/9/7		
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	390	375	48,927	2031/4/15	UKT 3.75% 09/07/20	3.75	3,500	3,963	673,087	2020/9/7		
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	250	258	33,642	2025/9/15	UKT 3.75% 09/07/21	3.75	750	862	146,513	2021/9/7		
RFGB 1.125% 09/15/18	1.125	550	572	74,593	2018/9/15	UKT 4% 01/22/60	4.0	1,200	1,795	305,012	2060/1/22		
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	400	439	57,254	2023/4/15	UKT 4% 03/07/22	4.0	2,050	2,409	409,154	2022/3/7		
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	150	165	21,638	2022/9/15	UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,100	2,790	473,935	2036/3/7		
RFGB 1.875% 04/15/17	1.875	500	513	66,975	2017/4/15	UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,050	2,678	454,914	2032/6/7		
RFGB 2% 04/15/24	2.0	650	739	96,417	2024/4/15	UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,300	1,756	298,281	2039/9/7		
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	430	569	74,222	2042/7/4	UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,050	1,335	226,889	2027/12/7		
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	600	737	96,209	2028/7/4	UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,600	2,181	370,520	2040/12/7		
RFGB 3.375% 04/15/20	3.375	900	1,037	135,249	2020/4/15	UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,950	2,775	471,461	2046/12/7		
RFGB 3.5% 04/15/21	3.5	1,000	1,189	155,074	2021/4/15	UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,500	2,190	371,986	2049/12/7		
RFGB 3.875% 09/15/17	3.875	700	748	97,630	2017/9/15	UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,630	2,499	424,456	2055/12/7		
RFGB 4% 07/04/25	4.0	650	862	112,385	2025/7/4	UKT 4.5% 03/07/19	4.5	2,500	2,804	476,237	2019/3/7		
RFGB 4.375% 07/04/19	4.375	300	348	45,439	2019/7/4	UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,180	2,963	503,295	2034/9/7		
(アイルランド) 国債証券						UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,040	2,920	496,049	2042/12/7		
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	200	206	26,939	2022/3/15	UKT 4.75% 03/07/20	4.75	250	290	49,343	2020/3/7		
IRISH 1% 05/15/26	1.0	270	270	35,234	2026/5/15	UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,900	2,589	439,854	2030/12/7		
IRISH 2% 02/18/45	2.0	500	505	65,892	2045/2/18	UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,700	2,445	415,388	2038/12/7		
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	750	848	110,640	2030/5/15	UKT 5% 03/07/18	5.0	1,520	1,667	283,204	2018/3/7		
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	850	1,030	134,282	2024/3/18	UKT 5% 03/07/25	5.0	2,350	3,060	519,864	2025/3/7		
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	500	620	80,889	2023/3/20	UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,200	1,791	304,300	2028/12/7		
IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	750	862	112,494	2019/6/18	UKT 8% 06/07/21	8.0	1,300	1,777	301,873	2021/6/7		
IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	1,150	1,366	178,164	2020/4/18	UKT 8.75% 08/25/17	8.75	770	871	148,068	2017/8/25		
IRISH 4.5% 10/18/18	4.5	970	1,093	142,524	2018/10/18	小 計				14,278,188			
IRISH 5% 10/18/20	5.0	1,100	1,354	176,607	2020/10/18	(スイス) 国債証券		千スイスフラン	千スイスフラン				
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,200	1,573	218,221	2025/3/13	SWISS 2% 04/28/21	2.0	250	286	33,798	2021/4/28		
IRISH 5.5% 10/18/17	5.5	400	439	57,313	2017/10/18	SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	500	569	67,143	2020/7/6		
IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	700	854	111,345	2019/10/18	SWISS 3% 01/08/18	3.0	730	786	92,685	2018/1/8		
小 計				72,419,805		SWISS 3% 05/12/19	3.0	550	622	73,323	2019/5/12		
(イギリス) 国債証券						SWISS 4% 02/11/23	4.0	460	609	71,892	2023/2/11		
UKT 1% 09/07/17	1.0	3,050	3,080	523,184	2017/9/7	SWISS 4% 04/08/28	4.0	600	907	106,942	2028/4/8		
UKT 1.25% 07/22/18	1.25	3,200	3,258	553,382	2018/7/22	SWISS 4.25% 06/05/17	4.25	600	641	75,623	2017/6/5		
UKT 1.5% 01/22/21	1.5	1,400	1,436	243,899	2021/1/22	小 計				521,408			
UKT 1.75% 07/22/19	1.75	2,600	2,693	457,527	2019/7/22	(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				
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	2,600	2,694	457,628	2022/9/7	SGB 1% 11/12/26	1.0	2,450	2,503	34,627	2026/11/12		
UKT 2% 07/22/20	2.0	2,920	3,063	520,389	2020/7/22	SGB 1.5% 11/13/23	1.5	7,250	7,890	109,124	2023/11/13		
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,450	1,507	256,004	2025/9/7	SGB 2.5% 05/12/25	2.5	6,000	7,067	97,737	2025/5/12		
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,270	2,420	411,169	2023/9/7	SGB 3.5% 03/30/39	3.5	4,740	6,487	89,726	2039/3/30		

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
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	千円		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	8,200	9,909	137,049	2022/6/1	ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	600	601	49,964	2027/11/21
SGB 3.75% 08/12/17	3.75	7,250	7,726	106,851	2017/8/12	ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,150	2,280	189,346	2025/4/21
SGB 4.25% 03/12/19	4.25	8,810	10,083	139,447	2019/3/12	ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,250	1,310	108,838	2029/4/21
SGB 5% 12/01/20	5.0	7,650	9,522	131,693	2020/12/1	ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	50	50	4,174	2039/6/21
小 計				846,260		ACGB 3.25% 10/21/18	3.25	1,400	1,451	120,510	2018/10/21
(ノルウェー)		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ			ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,230	1,342	111,498	2037/4/21
国債証券						ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	2,400	2,760	229,213	2026/4/21
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	2,650	2,745	37,502	2025/3/13	ACGB 4.25% 07/21/17	4.25	1,850	1,912	158,781	2017/7/21
NGB 2% 05/24/23	2.0	5,350	5,669	77,443	2023/5/24	ACGB 4.5% 04/15/20	4.5	2,900	3,197	265,514	2020/4/15
NGB 3% 03/14/24	3.0	5,200	5,906	80,679	2024/3/14	ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,000	1,202	99,848	2033/4/21
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	7,350	8,435	115,229	2021/5/25	ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	1,750	2,106	174,952	2027/4/21
NGB 4.25% 05/19/17	4.25	6,250	6,539	89,328	2017/5/19	ACGB 5.25% 03/15/19	5.25	2,550	2,808	233,257	2019/3/15
NGB 4.5% 05/22/19	4.5	6,450	7,268	99,283	2019/5/22	ACGB 5.5% 01/21/18	5.5	2,300	2,458	204,177	2018/1/21
小 計				499,467		ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	2,350	2,841	235,921	2023/4/21
(デンマーク)		千デンマーククローネ	千デンマーククローネ			ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	2,250	2,657	220,680	2021/5/15
国債証券						ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	1,800	2,176	180,699	2022/7/15
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,050	7,708	134,669	2023/11/15	ACGB 6% 02/15/17	6.0	2,350	2,445	203,066	2017/2/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	4,650	5,165	90,237	2025/11/15	小 計				3,133,006	
DGB 3% 11/15/21	3.0	9,100	10,653	186,117	2021/11/15	(シンガポール)		千シンガポールドル	千シンガポールドル		
DGB 4% 11/15/17	4.0	4,850	5,231	91,400	2017/11/15	国債証券					
DGB 4% 11/15/19	4.0	9,670	11,212	195,882	2019/11/15	SIGB 0.5% 04/01/18	0.5	650	641	53,403	2018/4/1
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	12,350	21,091	368,474	2039/11/15	SIGB 1.625% 10/01/19	1.625	100	100	8,396	2019/10/1
DGB 7% 11/10/24	7.0	2,650	4,180	73,041	2024/11/10	SIGB 2% 07/01/20	2.0	100	101	8,465	2020/7/1
小 計				1,139,823		SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	520	531	44,201	2021/6/1
(ポーランド)		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			SIGB 2.375% 04/01/17	2.375	400	406	33,842	2017/4/1
国債証券						SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	150	152	12,716	2025/6/1
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	520	508	15,019	2020/4/25	SIGB 2.5% 06/01/19	2.5	850	883	73,496	2019/6/1
POLGB 2% 04/25/21	2.0	1,000	985	29,133	2021/4/25	SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	480	485	40,354	2042/4/1
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	4,100	4,192	123,902	2018/7/25	SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	400	418	34,852	2023/7/1
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	700	662	19,574	2026/7/25	SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	200	209	17,427	2029/7/1
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	3,250	3,406	100,671	2019/7/25	SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	250	259	21,621	2030/9/1
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	2,700	2,767	81,764	2025/7/25	SIGB 3% 09/01/24	3.0	700	747	62,224	2024/9/1
POLGB 3.75% 04/25/18	3.75	2,200	2,307	68,196	2018/4/25	SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	500	536	44,638	2022/9/1
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,300	3,578	105,747	2023/10/25	SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	620	664	55,244	2020/9/1
POLGB 4.75% 04/25/17	4.75	1,940	2,018	59,638	2017/4/25	SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	300	332	27,686	2033/9/1
POLGB 5.25% 10/25/17	5.25	2,350	2,502	73,949	2017/10/25	SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	550	611	50,911	2027/3/1
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	1,940	2,209	65,305	2020/10/25	SIGB 4% 09/01/18	4.0	700	750	62,451	2018/9/1
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	2,200	2,486	73,465	2019/10/25	小 計				651,938	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	1,150	1,440	42,554	2029/4/25	(マレーシア)		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	1,800	2,148	63,488	2022/9/23	国債証券					
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	1,850	2,181	64,473	2021/10/25	MCS 3.26% 03/01/18	3.26	1,200	1,202	33,754	2018/3/1
小 計				986,885		MCS 3.418% 08/15/22	3.418	1,950	1,912	53,692	2022/8/15
(オーストラリア)		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			MCS 3.48% 03/15/23	3.48	1,600	1,564	43,902	2023/3/15
国債証券						MCS 3.492% 03/31/20	3.492	1,600	1,605	45,055	2020/3/31
ACGB 1.75% 11/21/20	1.75	250	246	20,491	2020/11/21	MCS 3.502% 05/31/27	3.502	670	629	17,662	2027/5/31
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,600	2,658	220,787	2024/4/21	MCS 3.58% 09/28/18	3.58	1,800	1,817	51,013	2018/9/28
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	550	519	43,116	2035/6/21	MCS 3.759% 03/15/19	3.759	2,300	2,334	65,528	2019/3/15
ACGB 2.75% 10/21/19	2.75	680	700	58,166	2019/10/21						

銘柄	利率	期末			償還年月日
		額面金額	評価額	外貨換算金額	
	%	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 3.814% 02/15/17	3.814	1,100	1,113	31,256	2017/2/15
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	830	769	21,608	2033/4/15
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,050	1,067	29,964	2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	640	623	17,509	2027/3/15
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	350	339	9,533	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	2,000	2,049	57,542	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,850	1,879	52,752	2024/7/15
MGS 4.24% 02/07/18	4.24	3,800	3,880	108,928	2018/2/7
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	2,800	2,897	81,338	2019/11/29
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	950	973	27,316	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,100	1,137	31,920	2030/4/15
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	750	776	21,794	2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	950	1,037	29,130	2028/9/15
小計				831,205	
(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	18,700	20,362	148,849	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	10,300	7,168	52,402	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	9,250	6,386	46,687	2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	6,550	5,996	43,833	2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	10,240	8,136	59,477	2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	6,750	6,441	47,087	2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	5,750	5,372	39,271	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	4,900	4,315	31,547	2030/1/31

銘柄	利率	期末			償還年月日
		額面金額	評価額	外貨換算金額	
	%	千南アフリ カランド	千南アフリ カランド	千円	
SAGB 8% 12/21/18	8.0	4,700	4,651	34,004	2018/12/21
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	4,950	4,376	31,995	2032/3/31
SAGB 8.25% 09/15/17	8.25	4,900	4,918	35,956	2017/9/15
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	5,250	4,625	33,811	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	3,450	3,053	22,321	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	9,450	8,350	61,041	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	2,800	2,582	18,875	2035/2/28
小計				707,163	
合計				177,598,047	

(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	204	—
US 5YR NOTE	325	—
EURO-BOBL FU	259	—
EURO-BUND	511	—
US 10YR NOTE	213	—
US LONG BOND	133	—

(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	%
コーポレートローン等、その他	177,598,047	97.6
投資信託財産総額	4,383,314	2.4
	181,981,361	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(179,517,129千円)の投資信託財産総額(181,981,361千円)に対する比率は98.6%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=117.02円、1カナダドル=84.21円、1メキシコペソ=6.35円、1ユーロ=130.37円、1イギリスポンド=169.84円、1スイスフラン=117.87円、1スウェーデンクローナ=13.83円、1ノルウェークローネ=13.66円、1デンマーククローネ=17.47円、1ポーランドズロチ=29.55円、1オーストラリアドル=83.04円、1シンガポールドル=83.19円、1マレーシアリンギット=28.07円、1南アフリカカランド=7.31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 2016年2月8日現在
(A) 資 産	184,172,772,204円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,552,200,305
公 社 債(評価額)	177,598,047,291
未 収 入 金	2,253,649,782
未 収 利 息	1,596,718,269
前 払 費 用	36,167,524
差 入 委 託 証 拠 金	135,989,033
(B) 負 債	2,357,158,412
未 払 金	2,205,705,886
未 払 解 約 金	151,452,526
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	181,815,613,792
元 本	75,888,868,174
次 期 繰 越 損 益 金	105,926,745,618
(D) 受 益 権 総 口 数	75,888,868,174口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,958円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年2月10日 至 2016年2月 8日
(A) 配 当 等 収 益	5,423,620,502円
受 取 利 息	5,423,772,882
支 払 利 息	△152,380
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△8,543,002,619
売 買 益	2,632,313,987
売 買 損	△11,175,316,606
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△52,102,558
取 引 益	176,407,537
取 引 損	△228,510,095
(D) そ の 他 費 用	△28,319,241
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△3,199,803,916
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	149,331,326,984
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,205,694,420
(H) 解 約 差 損 益 金	△49,410,471,870
(I) 計 (E+F+G+H)	105,926,745,618
次 期 繰 越 損 益 金(I)	105,926,745,618

(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

一般社団法人投資信託協会「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2015年3月11日)