

## 運用報告書 (全体版)

第10期<決算日2018年10月12日>

### DIAM外国債券パッシブ・ファンド

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	2009年1月30日から無期限です。
運用方針	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	DIAM外国債券パッシブ・ファンド
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
運用方法	原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。
	マザーファンドにおいては、外国債券への投資は原則として高位を維持します。
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。
	株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
分配方針	決算日 (原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の利子配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM外国債券パッシブ・ファンド」は、2018年10月12日に第10期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

## DIAM外国債券パッシブ・ファンド

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配 金	期中 騰落 率	期 騰落 率	中 騰落 率			
6期 (2014年10月14日)	円 15,255	円 0	% 12.3	ポイント 108,736.93	% 12.7	% 97.7	% -	百万円 6,269
7期 (2015年10月13日)	16,473	0	8.0	118,417.96	8.9	97.4	-	7,386
8期 (2016年10月12日)	14,404	0	△12.6	103,992.55	△12.2	97.3	-	8,188
9期 (2017年10月12日)	15,910	0	10.5	115,318.15	10.9	96.8	-	12,486
10期 (2018年10月12日)	15,406	0	△3.2	112,209.80	△2.7	97.4	-	14,065

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています (以下同じ)。

(注4) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します (以下同じ)。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2017 年 10 月 12 日	15,910	% -	115,318.15	% -	% 96.8	% -
10 月 末	15,917	0.0	115,508.10	0.2	97.3	-
11 月 末	15,924	0.1	115,672.53	0.3	97.9	-
12 月 末	16,116	1.3	117,078.37	1.5	98.0	-
2018 年 1 月 末	15,712	△1.2	114,201.85	△1.0	96.8	-
2 月 末	15,304	△3.8	111,369.59	△3.4	98.0	-
3 月 末	15,399	△3.2	112,110.56	△2.8	96.5	-
4 月 末	15,582	△2.1	113,447.49	△1.6	101.7	-
5 月 末	15,174	△4.6	110,306.34	△4.3	97.4	-
6 月 末	15,395	△3.2	112,167.37	△2.7	97.3	-
7 月 末	15,504	△2.6	113,026.89	△2.0	97.4	-
8 月 末	15,487	△2.7	112,887.86	△2.1	97.0	-
9 月 末	15,739	△1.1	115,005.76	△0.3	97.2	-
(期 末) 2018 年 10 月 12 日	15,406	△3.2	112,209.80	△2.7	97.4	-

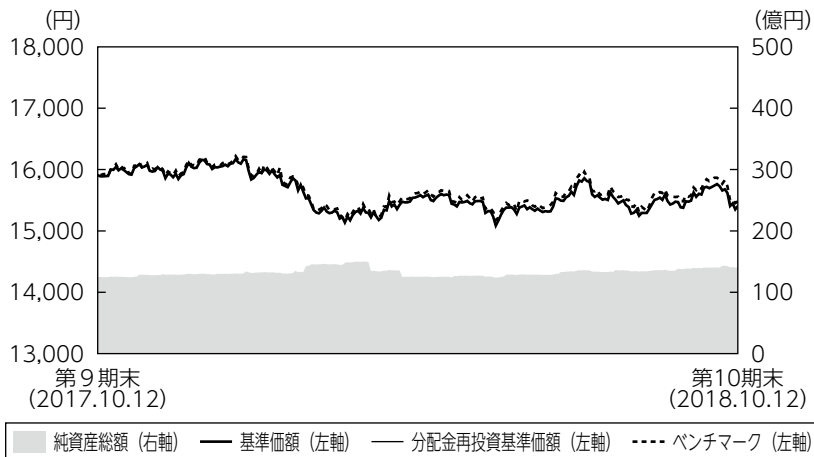
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2017年10月13日から2018年10月12日まで）

### 基準価額等の推移



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

### 基準価額の主な変動要因

堅調な経済成長を続けている米国で利上げが継続し、米国債利回りが上昇（価格は下落）したことや、イタリアでの財政拡大リスク等によりユーロが円に対して下落したことなどがマイナスに寄与し、基準価額は下落しました。

## 投資環境

外国債券市場では、米国債の利回りは上昇し、欧州債の利回りは概ねレンジ内での推移となりました。米国では堅調な経済情勢を背景に段階的に利上げが行われ、米国債利回りは上昇しました。欧州圏ではECB（欧州中央銀行）が金融緩和政策を継続する中で金利の上昇は抑えられ、欧州債の利回りは概ねレンジ内での推移となりました。

為替市場ではユーロが円に対して下落し、ドル円は前期末と概ね同水準となりました。イタリアでポピュリズム政権が樹立し、財政拡大リスクが懸念されたことなどから、ユーロ円は下落しました。ドル円は期の前半は米トランプ政権のドル安容認発言などが材料視され、一時円高ドル安に振れる局面もありましたが、期の後半は、米国の利上げが継続される中、円安ドル高となり、期を通じてみるとドル円は前期末とほぼ同水準となりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

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

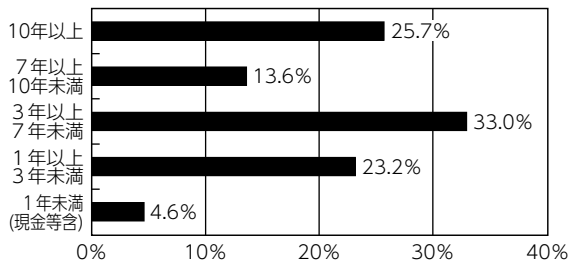
### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

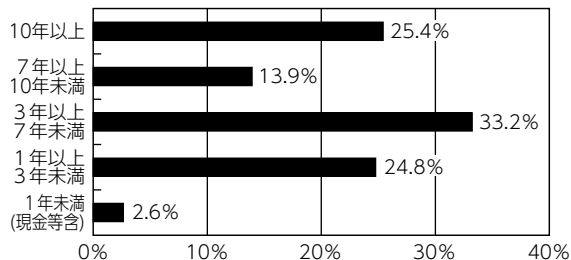
【運用状況】 ※比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

○残存期間別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

	ファンド	世界国債 インデックス	差
北米			
米国	41.9%	42.9%	△1.0%
カナダ	2.1%	2.1%	△0.1%
計	44.0%	45.1%	△1.1%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.9%	△0.1%
計	0.8%	0.9%	△0.1%
欧州			
オーストリア	1.6%	1.6%	△0.1%
ベルギー	2.5%	2.6%	△0.1%
フィンランド	0.6%	0.6%	0.1%
フランス	10.2%	10.5%	△0.3%
ドイツ	7.1%	7.3%	△0.1%
アイルランド	0.8%	0.9%	△0.1%
イタリア	9.6%	9.8%	△0.2%
オランダ	2.1%	2.2%	△0.1%
スペイン	5.7%	5.8%	△0.2%
ユーロ計	40.1%	41.2%	△1.1%
デンマーク	0.6%	0.7%	△0.1%
スウェーデン	0.5%	0.5%	△0.0%
スイス	0.0%	0.2%	△0.2%
英国	6.6%	7.0%	△0.4%
ポーランド	0.6%	0.7%	△0.0%
ノルウェー	0.3%	0.3%	△0.0%
計	48.7%	50.5%	△1.8%
アジア・ オセアニア			
オーストラリア	2.1%	2.2%	△0.1%
シンガポール	0.3%	0.4%	△0.0%
マレーシア	0.4%	0.4%	△0.1%
計	2.8%	3.0%	△0.2%
アフリカ			
南アフリカ	0.5%	0.6%	△0.0%
計	0.5%	0.6%	△0.0%
現金など	3.2%	—	—
合計	100.0%	100.0%	—

期末

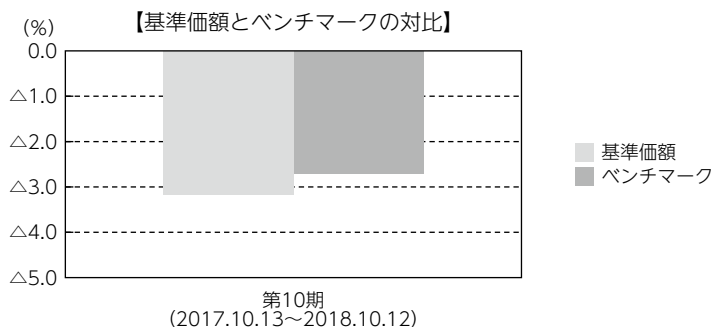
	ファンド	世界国債 インデックス	差
北米			
米国	44.0%	44.8%	△0.8%
カナダ	1.9%	2.0%	△0.1%
計	46.0%	46.8%	△0.9%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.9%	△0.1%
計	0.8%	0.9%	△0.1%
欧州			
オーストリア	1.6%	1.5%	0.0%
ベルギー	2.5%	2.5%	△0.0%
フィンランド	0.6%	0.6%	0.0%
フランス	9.9%	10.6%	△0.7%
ドイツ	6.8%	7.0%	△0.2%
アイルランド	0.8%	0.8%	△0.1%
イタリア	8.8%	9.0%	△0.2%
オランダ	2.1%	2.1%	0.0%
スペイン	6.2%	6.0%	0.2%
ユーロ計	39.2%	40.2%	△1.0%
デンマーク	0.5%	0.6%	△0.1%
スウェーデン	0.3%	0.4%	△0.0%
英国	6.4%	6.5%	△0.2%
ポーランド	0.6%	0.6%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.1%
計	47.3%	48.6%	△1.4%
アジア・ オセアニア			
オーストラリア	2.0%	2.2%	△0.2%
シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
マレーシア	0.4%	0.5%	△0.0%
計	2.8%	3.1%	△0.3%
アフリカ			
南アフリカ	0.5%	0.6%	△0.0%
計	0.5%	0.6%	△0.0%
現金など	2.6%	—	—
合計	100.0%	100.0%	—

(注) 世界国債インデックスとは、F T S E世界国債インデックス (除く日本) です。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.7%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.5%下回りました。信託報酬等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

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

## ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2017年10月13日 ～2018年10月12日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	5,705円

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

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

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

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

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

### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第10期		項目の概要
	(2017年10月13日 ～2018年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	76円	0.486%	(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15,616円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託銀行分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(67)	(0.432)	
(販売会社)	( 3)	(0.022)	
(受託銀行)	( 5)	(0.032)	
(b) その他費用	2	0.015	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用
(保管費用)	( 2)	(0.011)	
(監査費用)	( 1)	(0.004)	
(その他)	( 0)	(0.000)	
合計	78	0.501	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用はこのファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含まず。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2017年10月13日から2018年10月12日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 2,975,490	千円 5,411,580	千□ 1,905,799	千円 3,420,410

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2017年10月13日から2018年10月12日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ■ 組入資産の明細

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 6,759,004	千□ 7,828,695	千円 14,062,685



## ■投資信託財産の構成

2018年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14,062,685	99.7
コール・ローン等、その他	38,188	0.3
投資信託財産総額	14,100,873	100.0

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

(注2) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2018年10月12日現在、200,399,974千円、98.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.19円、1カナダ・ドル=86.12円、1オーストラリア・ドル=79.95円、1シンガポール・ドル=81.63円、1イギリス・ポンド=148.56円、1デンマーク・クローネ=17.44円、1ノルウェー・クローネ=13.68円、1スウェーデン・クローナ=12.51円、1メキシコ・ペソ=5.92円、1マレーシア・リンギット=27.01円、1南アフリカ・ランド=7.70円、1ポーランド・ズロチ=30.21円、1ユーロ=130.12円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	14,100,873,728円
コール・ローン等	34,958,243
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	14,062,685,485
未 収 入 金	3,230,000
(B) 負 債	35,384,885
未 払 解 約 金	2,916,854
未 払 信 託 報 酬	32,204,386
そ の 他 未 払 費 用	263,645
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	14,065,488,843
元 本	9,129,801,807
次 期 繰 越 損 益 金	4,935,687,036
(D) 受 益 権 総 口 数	9,129,801,807口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,406円

(注) 期首における元本額は7,847,945,760円、当期中における追加設定元本額は3,918,263,817円、同解約元本額は2,636,407,770円です。

## ■損益の状況

当期 自2017年10月13日 至2018年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△27,758円
受 取 利 息	3,462
支 払 利 息	△31,220
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△290,668,517
売 買 益	102,229,597
売 買 損	△392,898,114
(C) 信 託 報 酬 等	△66,755,139
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△357,451,414
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	775,926,589
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,517,211,861
(配 当 等 相 当 額)	(3,903,067,025)
(売 買 損 益 相 当 額)	(614,144,836)
(G) 合 計(D+E+F)	4,935,687,036
次 期 繰 越 損 益 金(G)	4,935,687,036
追 加 信 託 差 損 益 金	4,517,211,861
(配 当 等 相 当 額)	(3,908,016,610)
(売 買 損 益 相 当 額)	(609,195,251)
分 配 準 備 積 立 金	1,301,078,979
繰 越 損 益 金	△882,603,804

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	276,281,490円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	3,908,016,610
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,024,797,489
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	5,209,095,589
(f) 1万口当たり当期分配対象額	5,705.60
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

## 《お知らせ》

■信託報酬を年率0.45%（税込み0.486%）に引き下げる所要の約款変更を行いました。

（2018年1月13日）

■当ファンドおよび当ファンドが投資対象とする「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

（D I AM外国債券パッシブ・ファンド：2018年1月13日）

（外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド：2018年3月1日）

■当ファンドおよび当ファンドが投資対象とする「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」のベンチマークの名称に変更があるため約款に所要の変更を行いました。

変更前：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）

変更後：F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）

なお、当該名称変更は、「シティ債券インデックス」のロンドン証券取引所グループによる買収に伴うものであり、ファンドの運用方針および運用プロセスを変更するものではありません。

（D I AM外国債券パッシブ・ファンド：2018年3月1日）

（外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド：2018年3月1日）

# 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第15期（決算日 2018年2月21日）

（計算期間 2017年2月22日～2018年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		シティ世界国債インデックス		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（ベンチマーク）	期中騰落率			
11期（2014年2月21日）	16,392	13.0%	102,469.19	12.6%	97.6%	-	383,685
12期（2015年2月23日）	18,820	14.8%	117,697.87	14.9%	97.5%	-	345,838
13期（2016年2月22日）	17,881	△5.0%	111,769.89	△5.0%	97.6%	-	267,780
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9%	108,792.68	△2.7%	97.9%	-	248,485
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9%	111,885.82	2.8%	97.7%	-	217,863

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

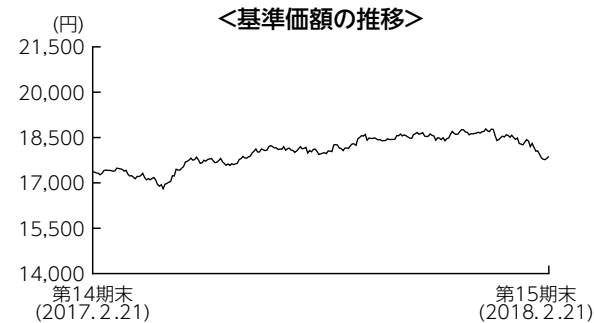
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率		騰 落 率			
(期 首) 2017 年 2 月 21 日	円 17,364	% -	ポイント 108,792.68	% -	% 97.9	% -
2 月 末	17,314	△0.3	108,568.93	△0.2	97.3	-
3 月 末	17,317	△0.3	108,641.98	△0.1	96.8	-
4 月 末	17,422	0.3	109,024.53	0.2	96.9	-
5 月 末	17,684	1.8	110,685.94	1.7	97.7	-
6 月 末	18,019	3.8	112,709.17	3.6	98.4	-
7 月 末	18,008	3.7	112,671.90	3.6	98.2	-
8 月 末	18,265	5.2	114,354.58	5.1	98.1	-
9 月 末	18,469	6.4	115,558.22	6.2	97.8	-
10 月 末	18,471	6.4	115,508.10	6.2	97.4	-
11 月 末	18,487	6.5	115,672.53	6.3	97.9	-
12 月 末	18,719	7.8	117,078.37	7.6	98.1	-
2018 年 1 月 末	18,258	5.1	114,201.85	5.0	96.9	-
(期 末) 2018 年 2 月 21 日	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2017年2月22日から2018年2月21日まで）

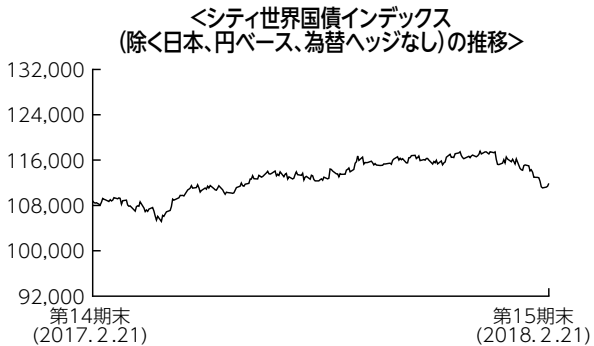


### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は17,876円となり、前期末比で2.9%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

世界的に景気が回復していることを背景にして、対ドイツ国債スプレッド（利回り格差）が広がっていたイタリア、スペイン、フランス等の国債利回りが低下（価格は上昇）したことや、ECB（欧州中央銀行）による金融政策の正常化が強く意識され円安ユーロ高が進んだことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。



### 投資環境

外国債券市場では、期初から2017年3月下旬にかけてFOMC（米連邦公開市場委員会）における利上げが意識されたことから債券利回りは上昇（価格は下落）して始まりました。米国のシリアへの空爆や北朝鮮情勢の緊迫化などが債券利回りの低下要因となった一方、各国中央銀行関係者が相次いで利上げに前向きな発言をしたことなどが上昇要因となり、12月末まではレンジ内の動きとなりました。年が明けると、株式市場の上昇や経済指標が良好だったことなどを背景にして期末にかけて債券利回りは上昇しました。

為替市場では、円は対ドルに対しては円高が進み、対ユーロに対しては円安が進みました。対ドルでは、2017年12月までレンジ内の動きとなりましたが、年が明けると、日銀による金融政策の正常化が意識されたことや、株式市場の急落からリスク回避的な動きが強まったことを背景にして、期末にかけて円高が進みました。一方、対ユーロでは、ECBによる金融政策の正常化が意識されたことなどから、円安が進みました。

## ポートフォリオについて

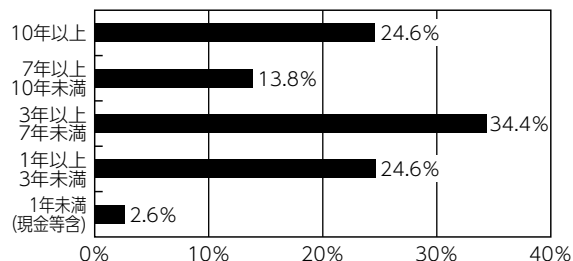
ベンチマークとリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

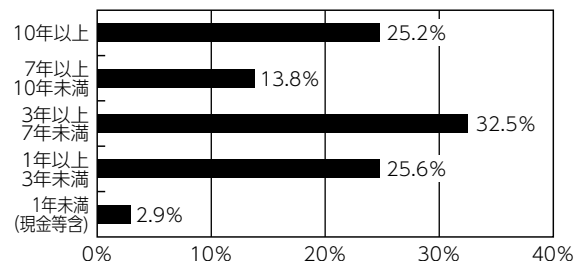
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○残存別構成比

#### 期首（前期末）



#### 期末



### ○国別構成比

#### 期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債 インデックス	差
北米	米国	44.3%	△0.1%
	カナダ	2.2%	△0.0%
	計	46.5%	△0.2%
中南米	メキシコ	0.8%	△0.0%
	計	0.8%	△0.0%
欧州	オーストリア	1.5%	△0.1%
	ベルギー	2.5%	△0.1%
	フィンランド	0.6%	△0.1%
	フランス	9.9%	△0.3%
	ドイツ	7.3%	△0.1%
	アイルランド	0.8%	△0.1%
	イタリア	9.5%	△0.2%
	オランダ	2.3%	△0.1%
	スペイン	5.6%	△0.2%
	ユーロ計	39.9%	△1.2%
	デンマーク	0.6%	△0.1%
	スウェーデン	0.5%	△0.1%
	スイス	0.2%	△0.2%
	英国	7.2%	△0.1%
ポーランド	0.6%	△0.1%	
ノルウェー	0.3%	△0.1%	
	計	49.3%	△1.7%
アジア・ オセアニア	オーストラリア	2.1%	△0.0%
	シンガポール	0.4%	△0.0%
	マレーシア	0.4%	△0.1%
	計	2.9%	△0.1%
アフリカ	南アフリカ	0.5%	△0.0%
	計	0.5%	△0.0%
現金など	2.1%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

#### 期末

国	当ファンド	世界国債 インデックス	差
北米	米国	41.9%	△0.6%
	カナダ	2.1%	△0.1%
	計	44.1%	△0.7%
中南米	メキシコ	0.8%	△0.0%
	計	0.8%	△0.0%
欧州	オーストリア	1.6%	△0.1%
	ベルギー	2.5%	△0.1%
	フィンランド	0.6%	△0.0%
	フランス	10.3%	△0.2%
	ドイツ	7.1%	△0.2%
	アイルランド	0.8%	△0.1%
	イタリア	10.0%	△0.2%
	オランダ	2.1%	△0.1%
	スペイン	5.9%	△0.1%
	ユーロ計	41.9%	△1.0%
	デンマーク	0.6%	△0.0%
スウェーデン	0.5%	△0.0%	
スイス	0.0%	△0.2%	
英国	7.0%	△0.2%	
ポーランド	0.7%	△0.0%	
ノルウェー	0.3%	△0.0%	
	計	51.4%	△1.5%
アジア・ オセアニア	オーストラリア	2.2%	△0.1%
	シンガポール	0.4%	△0.0%
	マレーシア	0.4%	△0.1%
	計	3.1%	△0.2%
アフリカ	南アフリカ	0.6%	△0.0%
	計	0.6%	△0.0%
現金など	2.3%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

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

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.8%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で+0.1%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスになりました。なお、乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

## 今後の運用方針

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) そ の 他 費 用	2円	0.012%
（保 管 費 用）	(2)	(0.010)
（そ の 他）	(0)	(0.001)
合 計	2	0.012

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(18,042円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■売買及び取引の状況 (2017年2月22日から2018年2月21日まで)

### 公社債

			買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 184,922	千アメリカ・ドル 293,487	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 14,554	千カナダ・ドル 20,648	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 7,723	千オーストラリア・ドル 10,364	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,611	千シンガポール・ドル 2,641	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 12,285	千イギリス・ポンド 32,531	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 3,570	千デンマーク・クローネ 14,678	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 7,841	千ノルウェー・クローネ 660	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 7,996	千スウェーデン・クローナ 10,435	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 39,926	千メキシコ・ペソ 79,526	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 1,908	千マレーシア・リンギット 6,039	
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 14,403	千南アフリカ・ランド 19,987	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 9,062	千ポーランド・ズロチ 14,268	
国	ユーロ圏	アイルランド	国債証券	千ユーロ 1,949	千ユーロ 3,818
		オランダ	国債証券	3,472	12,666
		ベルギー	国債証券	3,044	10,672
		フランス	国債証券	17,867	46,456
		ドイツ	国債証券	16,502	42,841
		スペイン	国債証券	13,469	27,530
		イタリア	国債証券	17,625	44,913
		フィンランド	国債証券	687	2,167
オーストリア	国債証券	2,994	4,836		

(注) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

## ■利害関係人との取引状況等 (2017年2月22日から2018年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。



## ■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 846,210	千アメリカ・ドル 837,189	千円 90,031,363	% 41.3	% -	% 16.9	% 15.7	% 8.8	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 50,650	千カナダ・ドル 53,987	千円 4,590,516	2.1	-	0.9	0.7	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 52,700	千オーストラリア・ドル 55,466	千円 4,706,926	2.2	-	1.4	0.6	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 9,250	千シンガポール・ドル 9,550	千円 778,949	0.4	-	0.2	0.2	-	
イギリス	千イギリス・ポンド 83,200	千イギリス・ポンド 101,610	千円 15,301,492	7.0	-	5.0	1.5	0.5	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 57,770	千デンマーク・クローネ 70,609	千円 1,257,549	0.6	-	0.4	0.1	0.1	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 43,360	千ノルウェー・クローネ 45,354	千円 622,265	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 66,280	千スウェーデン・クローナ 74,882	千円 994,434	0.5	-	0.2	0.2	0.1	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 287,000	千メキシコ・ペソ 292,501	千円 1,681,884	0.8	-	0.5	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リングギット 33,430	千マレーシア・リングギット 33,363	千円 918,489	0.4	-	0.2	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 155,240	千南アフリカ・ランド 148,622	千円 1,362,871	0.6	-	0.6	0.0	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 43,900	千ポーランド・ズロチ 45,657	千円 1,459,674	0.7	-	0.2	0.4	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	11,690	13,006	1,725,608	0.8	-	0.5	0.2	0.1	
オランダ	29,660	34,239	4,542,619	2.1	-	1.3	0.6	0.2	
ベルギー	34,830	41,872	5,555,222	2.5	-	1.8	0.6	0.2	
フランス	144,580	169,206	22,448,608	10.3	-	6.6	2.7	1.0	
ドイツ	101,280	116,732	15,486,921	7.1	-	4.0	2.3	0.9	
スペイン	83,630	97,575	12,945,318	5.9	-	3.8	1.5	0.7	
イタリア	144,250	163,824	21,734,606	10.0	-	5.9	2.9	1.2	
フィンランド	8,700	9,556	1,267,806	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
オーストリア	21,660	25,571	3,392,630	1.6	-	1.0	0.4	0.2	
合 計	-	-	千円 212,805,760	97.7	-	51.7	31.3	14.6	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

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

(B) 個別銘柄開示  
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当	期				末		
		種	利	額	評		額	
					類			率
金額	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.125 01/31/21	国債証券	2.1250	5,000	4,959	533,328	2021/01/31		
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	5,000	4,791	515,267	2023/01/31		
US T N/B 1.375 01/31/20	国債証券	1.3750	8,600	8,456	909,445	2020/01/31		
US T N/B 1.25 01/31/20	国債証券	1.2500	10,800	10,594	1,139,376	2020/01/31		
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	3,200	3,923	421,931	2026/02/15		
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,800	1,801	193,722	2042/02/15		
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	3,600	3,592	386,385	2043/02/15		
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	5,000	4,389	472,079	2046/02/15		
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	1,300	1,387	149,193	2039/02/15		
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	1,000	1,218	130,988	2029/02/15		
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,500	1,892	203,571	2031/02/15		
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	2,000	2,415	259,709	2036/02/15		
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,800	2,286	245,849	2041/02/15		
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	5,000	5,425	583,485	2044/02/15		
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	17,500	17,132	1,842,391	2022/02/15		
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	750	899	96,678	2038/02/15		
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	2,800	3,488	375,119	2040/02/15		
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	5,500	5,009	538,699	2026/02/15		
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	5,500	4,845	521,090	2045/02/15		
US T N/B 2.75 02/15/19	国債証券	2.7500	12,000	12,077	1,298,842	2019/02/15		
US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	3.6250	17,000	17,444	1,876,023	2020/02/15		
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	5,200	5,045	542,560	2047/02/15		
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	9,400	9,399	1,010,795	2024/02/15		
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	9,500	9,001	967,994	2025/02/15		
US T N/B 1.375 02/28/19	国債証券	1.3750	13,000	12,907	1,388,024	2019/02/28		
US T N/B 3.625 02/15/21	国債証券	3.6250	5,500	5,688	611,775	2021/02/15		
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	9,500	9,210	990,460	2023/02/15		
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	12,000	11,375	1,223,323	2027/02/15		
US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	1.7500	11,700	11,325	1,217,904	2022/03/31		
US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	2.2500	11,500	11,432	1,229,462	2021/03/31		
US T N/B 1.625 03/31/19	国債証券	1.6250	15,000	14,919	1,604,453	2019/03/31		
US T N/B 1.375 03/31/20	国債証券	1.3750	6,300	6,182	664,846	2020/03/31		
US T N/B 1.375 04/30/20	国債証券	1.3750	12,000	11,761	1,264,863	2020/04/30		
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	1,400	1,875	201,668	2030/05/15		
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	2,000	2,412	259,489	2040/05/15		
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	2,000	2,418	260,094	2041/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	2,270	2,222	239,023	2042/05/15		
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	1,630	1,928	207,443	2039/05/15		
US T N/B 3.125 05/15/19	国債証券	3.1250	13,000	13,152	1,414,446	2019/05/15		
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	4,700	4,482	482,061	2043/05/15		
US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	3.5000	14,000	14,363	1,544,599	2020/05/15		
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	5,200	5,412	582,051	2044/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	5,000	4,862	522,913	2045/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	6,900	6,688	719,297	2047/05/15		
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	4,400	3,861	415,245	2046/05/15		

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.125 05/31/19	国債証券	1.1250	11,000	10,860	1,167,963	2019/05/31
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	11,600	11,214	1,206,035	2022/05/15
US T N/B 1.375 05/31/20	国債証券	1.3750	3,500	3,426	368,478	2020/05/31
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	1,100	1,341	144,216	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	7,000	6,681	718,581	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	9,000	8,857	952,577	2024/05/15
US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	3.1250	8,000	8,161	877,655	2021/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	5,000	4,767	512,745	2025/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	6,000	5,740	617,307	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	800	1,029	110,685	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	8,500	7,716	829,820	2026/05/15
US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	2.0000	12,000	11,821	1,271,264	2021/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	10,000	9,549	1,026,920	2024/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	7,000	6,541	703,465	2023/06/30
US T N/B 1.875 06/30/20	国債証券	1.8750	11,000	10,885	1,170,601	2020/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	9,500	9,315	1,001,749	2022/06/30
US T N/B 0.875 07/31/19	国債証券	0.8750	15,000	14,725	1,583,531	2019/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,181	127,064	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	2,000	2,212	237,880	2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	1,800	2,218	238,577	2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	2,100	2,363	254,221	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	2,800	2,618	281,539	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	4,600	4,582	492,749	2044/08/15
US T N/B 8.125 08/15/19	国債証券	8.1250	4,000	4,349	467,747	2019/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	1,400	1,713	184,242	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	4,200	4,555	489,879	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	4,900	4,648	499,855	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	9,000	8,487	912,730	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	6,100	5,620	604,432	2047/08/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.1250	11,000	10,861	1,168,058	2021/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	8,000	7,916	851,372	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	8,900	8,676	933,101	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	4,500	3,735	401,734	2046/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	8,000	7,560	813,062	2027/08/15
US T N/B 3.625 08/15/19	国債証券	3.6250	5,000	5,103	548,851	2019/08/15
US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	2.6250	16,500	16,607	1,785,979	2020/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	7,000	6,266	673,851	2026/08/15
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	9,500	9,104	979,119	2022/08/15
US T N/B 1.0 08/31/19	国債証券	1.0000	13,500	13,259	1,425,977	2019/08/31
US T N/B 2.125 08/31/20	国債証券	2.1250	3,000	2,982	320,752	2020/08/31
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	12,000	11,620	1,249,636	2022/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	10,000	9,455	1,016,833	2024/08/31
US T N/B 1.0 09/30/19	国債証券	1.0000	15,000	14,719	1,582,902	2019/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	10,000	9,862	1,060,613	2021/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	10,000	9,589	1,031,201	2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	11,000	10,233	1,100,500	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	12,500	12,026	1,293,302	2022/09/30
US T N/B 2.0 09/30/20	国債証券	2.0000	6,000	5,945	639,336	2020/09/30

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.75 10/31/20	国債証券	1.7500	6,000	5,902	634,703	2020/10/31
US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	1.2500	15,000	14,762	1,587,516	2019/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	6,000	7,167	770,803	2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,500	1,821	195,852	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	1,400	1,782	191,663	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	5,100	4,961	533,585	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	2,000	2,373	255,271	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	3,400	3,175	341,467	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,800	1,801	193,752	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	4,900	5,424	583,302	2043/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	3,900	3,789	407,574	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	4,400	4,164	447,851	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	10,600	10,233	1,100,471	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,660	1,999	215,055	2039/11/15
US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	2.6250	6,000	6,037	649,272	2020/11/15
US T N/B 3.375 11/15/19	国債証券	3.3750	4,000	4,078	438,578	2019/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	10,400	10,205	1,097,479	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	10,000	9,575	1,029,770	2025/11/15
US T N/B 2.0 11/30/20	国債証券	2.0000	10,500	10,390	1,117,426	2020/11/30
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	7,500	7,165	770,569	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	10,000	10,015	1,077,077	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	7,000	6,511	700,198	2026/11/15
US T N/B 1.0 11/30/19	国債証券	1.0000	6,500	6,362	684,260	2019/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	2,100	1,981	213,112	2027/11/15
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	2,500	2,433	261,685	2023/12/31
US T N/B 2.375 12/31/20	国債証券	2.3750	8,300	8,294	891,948	2020/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	15,700	15,454	1,661,988	2021/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	8,000	7,809	839,818	2022/12/31
US T N/B 1.75 12/31/20	国債証券	1.7500	9,000	8,839	950,612	2020/12/31
小計	—	—	846,210	837,189	90,031,363	—
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 1.75 03/01/19	国債証券	1.7500	1,100	1,101	93,664	2019/03/01
CANADA 1.5 03/01/20	国債証券	1.5000	2,300	2,285	194,313	2020/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	600	589	50,125	2023/03/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,700	1,599	135,976	2026/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	1,000	1,471	125,146	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,600	2,132	181,353	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	1,550	2,204	187,411	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	1,600	2,216	188,502	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,600	1,628	138,438	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	1,800	2,278	193,725	2041/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.2500	4,700	4,889	415,742	2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	3,900	4,011	341,117	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	2,300	2,228	189,469	2023/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,500	1,500	127,585	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	800	712	60,558	2027/06/01
CANADA 3.5 06/01/20	国債証券	3.5000	3,800	3,937	334,794	2020/06/01
CANADA 3.75 06/01/19	国債証券	3.7500	3,700	3,795	322,712	2019/06/01

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 0.75 08/01/19	国債証券	0.7500	7,200	7,098	603,571	2019/08/01	
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	600	574	48,880	2021/09/01	
CANADA 0.75 09/01/20	国債証券	0.7500	2,400	2,333	198,386	2020/09/01	
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	800	762	64,871	2022/09/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	1,900	2,282	194,110	2045/12/01	
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	1,450	1,537	130,703	2048/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	750	815	69,354	2064/12/01	
小計	—	—	50,650	53,987	4,590,516	—	
<b>(オーストラリア)</b>		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	1,250	1,134	96,297	2047/03/21	
AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	国債証券	5.2500	2,600	2,692	228,508	2019/03/15	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	3,100	3,205	272,028	2025/04/21	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	3,600	4,148	352,032	2027/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	3,100	3,123	265,094	2024/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	3,600	3,980	337,823	2026/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	国債証券	4.5000	3,800	3,995	339,026	2020/04/15	
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	3,000	3,437	291,664	2023/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	3,100	3,191	270,810	2029/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	1,500	1,749	148,469	2033/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	1,500	1,597	135,532	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	2,400	2,261	191,912	2028/05/21	
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.7500	3,700	4,106	348,516	2021/05/15	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	900	884	75,050	2039/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	900	841	71,398	2035/06/21	
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	4,000	4,564	387,314	2022/07/15	
AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	国債証券	2.7500	1,500	1,519	128,958	2019/10/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	2,700	2,657	225,476	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	2,900	2,863	242,988	2027/11/21	
AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	国債証券	1.7500	2,400	2,374	201,513	2020/11/21	
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券	2.0000	1,150	1,137	96,507	2021/12/21	
小計	—	—	52,700	55,466	4,706,926	—	
<b>(シンガポール)</b>		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	900	982	80,168	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	410	403	32,908	2046/03/01	
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	550	544	44,431	2042/04/01	
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	500	503	41,024	2025/06/01	
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	400	414	33,808	2029/07/01	
SINGAPORE 2.0 07/01/20	国債証券	2.0000	800	805	65,685	2020/07/01	
SINGAPORE 3.25 09/01/20	国債証券	3.2500	1,340	1,389	113,366	2020/09/01	
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	810	847	69,135	2024/09/01	
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	1,600	1,680	137,086	2022/09/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	460	475	38,755	2030/09/01	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	480	523	42,689	2033/09/01	
SINGAPORE 1.25 10/01/21	国債証券	1.2500	1,000	979	79,888	2021/10/01	
小計	—	—	9,250	9,550	778,949	—	
<b>(イギリス)</b>		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	2,800	3,521	530,227	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	2,650	3,490	525,606	2045/01/22	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(イギリス)</b>		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	1,700	2,818	424,427	2060/01/22
UK TREASURY 1.5 01/22/21	国債証券	1.5000	2,700	2,750	414,163	2021/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	2,030	2,531	381,208	2025/03/07
UK TREASURY 4.5 03/07/19	国債証券	4.5000	400	416	62,683	2019/03/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	4.0000	2,300	2,577	388,141	2022/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	2,450	3,331	501,728	2036/03/07
UK TREASURY 4.75 03/07/20	国債証券	4.7500	1,850	2,001	301,405	2020/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,850	2,417	364,119	2032/06/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国債証券	8.0000	1,700	2,092	315,119	2021/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	2,000	1,798	270,851	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	2,100	3,097	466,484	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,000	986	148,572	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	1,650	2,050	308,857	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	2,000	3,180	478,996	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	2,400	2,406	362,388	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	2,000	1,941	292,349	2027/07/22
UK TREASURY 2.0 07/22/20	国債証券	2.0000	1,700	1,749	263,442	2020/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	2,350	2,295	345,623	2022/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/19	国債証券	1.7500	4,400	4,467	672,793	2019/07/22
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	1,700	2,388	359,633	2039/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/21	国債証券	3.7500	1,850	2,033	306,283	2021/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	2,800	2,961	445,896	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	2,000	2,184	328,921	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	2,400	2,510	378,001	2025/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/20	国債証券	3.7500	2,900	3,115	469,136	2020/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/19	国債証券	3.7500	2,200	2,304	346,965	2019/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	2,350	3,229	486,346	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	900	872	131,315	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	3,150	3,248	489,153	2022/09/07
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	1,350	1,934	291,262	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	1,800	2,669	401,984	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	2,200	3,292	495,754	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	2,080	3,123	470,435	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	2,040	3,394	511,186	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	1,700	2,111	318,045	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,980	2,813	423,667	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,700	2,282	343,709	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	2,070	3,218	484,601	2049/12/07
小計	-	-	83,200	101,610	15,301,492	-
<b>(デンマーク)</b>		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	14,900	24,067	428,647	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	13,470	14,710	261,988	2025/11/15
DENMARK 4.0 11/15/19	国債証券	4.0000	7,900	8,526	151,849	2019/11/15
DENMARK 3.0 11/15/21	国債証券	3.0000	13,000	14,500	258,248	2021/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	5,500	5,888	104,865	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	3,000	2,916	51,949	2027/11/15
小計	-	-	57,770	70,609	1,257,549	-
<b>(ノルウェー)</b>		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	6,000	5,870	80,539	2026/02/19

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ノルウェー)</b>		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	500	493	6,776	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	7,400	8,012	109,936	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,800	3,810	52,278	2025/03/13
NORWAY 4.5 05/22/19	国債証券	4.5000	6,560	6,876	94,350	2019/05/22
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	7,600	7,815	107,223	2023/05/24
NORWAY 3.75 05/25/21	国債証券	3.7500	11,500	12,475	171,159	2021/05/25
小計	—	—	43,360	45,354	622,265	—
<b>(スウェーデン)</b>		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 4.25 03/12/19	国債証券	4.2500	8,800	9,268	123,079	2019/03/12
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	6,200	8,329	110,613	2039/03/30
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	10,300	11,771	156,319	2025/05/12
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	12,870	14,822	196,846	2022/06/01
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	9,700	10,382	137,884	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	7,000	7,171	95,232	2026/11/12
SWEDEN 5.0 12/01/20	国債証券	5.0000	11,410	13,136	174,458	2020/12/01
小計	—	—	66,280	74,882	994,434	—
<b>(メキシコ)</b>		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	5,000	4,417	25,401	2026/03/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	31,000	32,705	188,059	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	10,000	9,955	57,242	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	10,000	9,852	56,649	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	26,000	24,902	143,186	2022/06/09
MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	国債証券	6.5000	38,000	36,733	211,215	2021/06/10
MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	国債証券	8.0000	30,000	30,232	173,835	2020/06/11
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	22,000	21,673	124,622	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	5,000	5,046	29,016	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,000	15,951	91,721	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	13,000	15,722	90,404	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	7,000	6,944	39,929	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	35,000	39,314	226,056	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	14,212	81,721	2023/12/07
MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	国債証券	5.0000	26,000	24,838	142,821	2019/12/11
小計	—	—	287,000	292,501	1,681,884	—
<b>(マレーシア)</b>		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	779	21,447	2027/03/15
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,200	33,057	2023/03/15
MALAYSIA 3.492 03/31/20	国債証券	3.4920	2,200	2,205	60,717	2020/03/31
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,116	85,791	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	1,803	49,646	2030/04/15
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,850	1,766	48,632	2032/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,124	30,963	2033/04/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	2,570	2,419	66,596	2027/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	1,937	53,350	2028/06/15
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.1600	5,500	5,618	154,679	2021/07/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	1,430	1,447	39,840	2024/07/15
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	3,000	2,954	81,337	2022/08/15
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,600	1,717	47,280	2028/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,500	1,526	42,029	2043/09/30

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 4.378 11/29/19	国債証券	4.3780	3,680	3,745	103,117	2019/11/29
小計	—	—	33,430	33,363	918,489	—
(南アフリカ)		%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	国債証券	8.0000	13,110	12,597	115,522	2030/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8.7500	10,000	9,622	88,233	2044/01/31
SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	国債証券	9.0000	8,000	7,924	72,663	2040/01/31
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8.5000	10,910	10,394	95,317	2037/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8.7500	17,000	16,383	150,234	2048/02/28
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6.5000	11,760	8,836	81,028	2041/02/28
SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	国債証券	7.7500	10,000	10,134	92,929	2023/02/28
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	11,600	10,118	92,788	2031/02/28
SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	国債証券	8.8750	3,000	2,981	27,339	2035/02/28
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8.2500	10,000	9,614	88,164	2032/03/31
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6.2500	14,700	11,184	102,563	2036/03/31
SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	国債証券	6.7500	10,160	10,087	92,505	2021/03/31
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10.5000	25,000	28,743	263,580	2026/12/21
小計	—	—	155,240	148,622	1,362,871	—
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,761	56,309	2029/04/25
POLAND 1.5 04/25/20	国債証券	1.5000	3,000	2,989	95,583	2020/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	4,000	3,964	126,754	2022/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	4,200	3,954	126,425	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	4,700	4,713	150,702	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,300	2,133	68,207	2027/07/25
POLAND 1.75 07/25/21	国債証券	1.7500	2,200	2,170	69,391	2021/07/25
POLAND 3.25 07/25/19	国債証券	3.2500	2,500	2,562	81,921	2019/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	3,200	3,639	116,350	2022/09/23
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.2500	6,890	7,499	239,745	2020/10/25
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.7500	3,680	4,126	131,932	2021/10/25
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	3,100	3,284	105,018	2023/10/25
POLAND 5.5 10/25/19	国債証券	5.5000	2,690	2,856	91,331	2019/10/25
小計	—	—	43,900	45,657	1,459,674	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	890	918	121,816	2045/02/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	930	1,093	145,083	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	1,260	1,669	221,532	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	700	829	110,004	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0.8000	1,150	1,185	157,336	2022/03/15
IRISH 4.5 04/18/20	国債証券	4.5000	1,130	1,250	165,923	2020/04/18
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	1,100	1,236	164,030	2030/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	1,350	1,363	180,940	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	750	753	99,960	2037/05/15
IRISH 4.4 06/18/19	国債証券	4.4000	480	511	67,810	2019/06/18
IRISH 5.0 10/18/20	国債証券	5.0000	1,000	1,143	151,681	2020/10/18
IRISH 5.9 10/18/19	国債証券	5.9000	950	1,051	139,487	2019/10/18
小計	—	—	11,690	13,006	1,725,608	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,800	2,702	358,581	2042/01/15



銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…オランダ)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,540	2,033	269,826	2047/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	1,700	2,006	266,136	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	1,600	2,317	307,454	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,700	2,508	332,782	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,740	2,073	275,112	2033/01/15
NETHERLANDS 01/15/22	国債証券	—	1,900	1,908	253,224	2022/01/15
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	国債証券	0.2500	2,150	2,182	289,607	2020/01/15
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	国債証券	3.5000	1,670	1,829	242,717	2020/07/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	国債証券	3.2500	2,060	2,327	308,801	2021/07/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	2,000	2,169	287,811	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,900	1,876	248,922	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	1,550	1,706	226,416	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	2,000	2,207	292,892	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,700	1,665	221,019	2025/07/15
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	国債証券	4.0000	1,200	1,277	169,529	2019/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,450	1,445	191,780	2027/07/15
小計	—	—	29,660	34,239	4,542,619	—
<b>(ユーロ…ベルギー)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/22	国債証券	4.0000	1,800	2,101	278,758	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	2,700	3,905	518,177	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	2,000	3,037	403,043	2041/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/19	国債証券	4.0000	1,050	1,102	146,302	2019/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,200	1,565	207,692	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	950	1,294	171,751	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	2,500	3,891	516,242	2035/03/28
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	1,130	1,639	217,469	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	900	863	114,519	2047/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	700	733	97,280	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,500	1,529	202,969	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	2,600	2,954	392,036	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,300	1,262	167,503	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	1,700	1,886	250,325	2023/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	850	1,050	139,409	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	950	1,007	133,690	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	2,000	2,029	269,240	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	1,100	1,090	144,655	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	150	148	19,645	2037/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.2500	2,150	2,492	330,619	2021/09/28
BELGIUM 3.75 09/28/20	国債証券	3.7500	2,200	2,435	323,081	2020/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	1,950	2,327	308,851	2022/09/28
BELGIUM 3.0 09/28/19	国債証券	3.0000	1,300	1,372	182,129	2019/09/28
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	150	149	19,826	2023/10/22
小計	—	—	34,830	41,872	5,555,222	—
<b>(ユーロ…フランス)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	国債証券	3.7500	6,300	7,099	941,911	2021/04/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,700	2,431	322,563	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	4,840	5,944	788,655	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	3,900	6,090	808,059	2041/04/25

銘	柄	当				期		末									
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日		
									外	貨						建	金
<b>(ユーロ…フランス)</b>				%		千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円				
FRANCE OAT 4.0	04/25/55	国	債	証	券	4.0000	2,400		3,752			497,830					2055/04/25
FRANCE OAT 4.0	04/25/60	国	債	証	券	4.0000	1,940		3,108			412,345					2060/04/25
FRANCE OAT 4.25	04/25/19	国	債	証	券	4.2500	2,000		2,114			280,474					2019/04/25
FRANCE OAT 5.5	04/25/29	国	債	証	券	5.5000	3,650		5,373			712,886					2029/04/25
FRANCE OAT 3.0	04/25/22	国	債	証	券	3.0000	5,300		5,970			792,141					2022/04/25
FRANCE OAT 3.5	04/25/20	国	債	証	券	3.5000	8,300		9,011			1,195,596					2020/04/25
FRANCE OAT 4.75	04/25/35	国	債	証	券	4.7500	3,100		4,705			624,330					2035/04/25
FRANCE OAT 3.25	05/25/45	国	債	証	券	3.2500	3,000		3,979			527,992					2045/05/25
FRANCE OAT 1.75	05/25/66	国	債	証	券	1.7500	1,250		1,165			154,688					2066/05/25
FRANCE OAT 2.25	05/25/24	国	債	証	券	2.2500	4,000		4,462			592,031					2024/05/25
FRANCE OAT 2.5	05/25/30	国	債	証	券	2.5000	3,900		4,494			596,220					2030/05/25
FRANCE OAT 0.75	05/25/28	国	債	証	券	0.7500	1,500		1,464			194,238					2028/05/25
FRANCE OAT 1.5	05/25/31	国	債	証	券	1.5000	4,200		4,333			574,989					2031/05/25
FRANCE OAT 0.5	05/25/25	国	債	証	券	0.5000	3,700		3,687			489,200					2025/05/25
FRANCE OAT 0.5	05/25/26	国	債	証	券	0.5000	2,200		2,164			287,122					2026/05/25
FRANCE OAT 1.0	05/25/27	国	債	証	券	1.0000	4,000		4,047			537,021					2027/05/25
FRANCE OAT 1.0	05/25/19	国	債	証	券	1.0000	1,700		1,733			230,040					2019/05/25
FRANCE OAT 1.75	05/25/23	国	債	証	券	1.7500	4,400		4,759			631,381					2023/05/25
FRANCE OAT 1.25	05/25/36	国	債	証	券	1.2500	2,900		2,788			369,930					2036/05/25
FRANCE OAT	05/25/22	国	債	証	券	-	3,000		2,997			397,691					2022/05/25
FRANCE OAT 1.75	06/25/39	国	債	証	券	1.7500	1,200		1,232			163,537					2039/06/25
FRANCE OAT 4.25	10/25/23	国	債	証	券	4.2500	5,900		7,231			959,428					2023/10/25
FRANCE OAT 6.0	10/25/25	国	債	証	券	6.0000	2,900		4,085			541,987					2025/10/25
FRANCE OAT 2.75	10/25/27	国	債	証	券	2.7500	4,000		4,686			621,813					2027/10/25
FRANCE OAT 4.0	10/25/38	国	債	証	券	4.0000	3,200		4,608			611,347					2038/10/25
FRANCE OAT 3.25	10/25/21	国	債	証	券	3.2500	5,200		5,847			775,753					2021/10/25
FRANCE OAT 8.5	10/25/19	国	債	証	券	8.5000	4,200		4,839			642,094					2019/10/25
FRANCE OAT 5.75	10/25/32	国	債	証	券	5.7500	3,800		6,091			808,196					2032/10/25
FRANCE OAT 2.25	10/25/22	国	債	証	券	2.2500	4,000		4,404			584,395					2022/10/25
FRANCE OAT 3.75	10/25/19	国	債	証	券	3.7500	6,600		7,076			938,868					2019/10/25
FRANCE OAT 2.5	10/25/20	国	債	証	券	2.5000	8,700		9,360			1,241,881					2020/10/25
FRANCE OAT 1.75	11/25/24	国	債	証	券	1.7500	4,500		4,883			647,958					2024/11/25
FRANCE OAT 1.0	11/25/25	国	債	証	券	1.0000	3,700		3,803			504,608					2025/11/25
FRANCE OAT 0.25	11/25/26	国	債	証	券	0.2500	3,000		2,863			379,884					2026/11/25
FRANCE OAT 0.5	11/25/19	国	債	証	券	0.5000	500		508			67,506					2019/11/25
小	計	-	-	-	-	-	144,580		169,206			22,448,608					-
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>				%		千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円				
DEUTSCHLAND 6.25	01/04/24	国	債	証	券	6.2500	1,700		2,300			305,206					2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625	01/04/28	国	債	証	券	5.6250	1,600		2,349			311,768					2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25	01/04/30	国	債	証	券	6.2500	1,100		1,774			235,378					2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5	01/04/31	国	債	証	券	5.5000	2,050		3,195			423,925					2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0	01/04/37	国	債	証	券	4.0000	2,800		4,153			551,092					2037/01/04
DEUTSCHLAND 2.0	01/04/22	国	債	証	券	2.0000	4,400		4,773			633,267					2022/01/04
DEUTSCHLAND 3.25	01/04/20	国	債	証	券	3.2500	3,600		3,859			512,071					2020/01/04
DEUTSCHLAND 2.5	01/04/21	国	債	証	券	2.5000	2,200		2,383			316,274					2021/01/04
DEUTSCHLAND 0.5	02/15/25	国	債	証	券	0.5000	2,700		2,725			361,579					2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5	02/15/26	国	債	証	券	0.5000	3,200		3,202			424,896					2026/02/15
DEUTSCHLAND 1.5	02/15/23	国	債	証	券	1.5000	2,100		2,254			299,067					2023/02/15

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,500	1,636	217,164	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	3,500	3,388	449,578	2027/02/15
BUNDESSCHAT 03/15/19	国債証券	—	2,600	2,618	347,435	2019/03/15
BUNDESUBL 0.5 04/12/19	国債証券	0.5000	3,100	3,141	416,796	2019/04/12
BUNDESUBL 04/09/21	国債証券	—	2,200	2,223	294,991	2021/04/09
BUNDESUBL 04/08/22	国債証券	—	3,000	3,016	400,171	2022/04/08
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	2,000	2,153	285,736	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	2,500	2,685	356,225	2023/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,750	2,680	355,667	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,420	1,987	263,648	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,660	2,605	345,685	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,850	2,602	345,318	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,700	3,389	449,652	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	2,000	3,371	447,267	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.2500	3,150	3,527	468,001	2021/07/04
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3.0000	3,000	3,249	431,108	2020/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	2,400	2,595	344,332	2022/07/04
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	国債証券	3.5000	4,400	4,650	616,963	2019/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	2,400	3,726	494,433	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,700	3,423	454,151	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	3,200	3,335	442,553	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	1,700	1,672	221,826	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	—	2,800	2,671	354,376	2026/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	1,500	1,652	219,285	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	2,600	2,718	360,623	2024/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	3,100	3,374	447,753	2021/09/04
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2.2500	4,200	4,490	595,750	2020/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	3,400	3,642	483,208	2022/09/04
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	国債証券	0.2500	1,500	1,527	202,684	2020/10/16
小計	—	—	101,280	116,732	15,486,921	—
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	2,700	3,296	437,290	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	3,000	4,305	571,247	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	2,200	2,722	361,234	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	2,380	3,099	411,223	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	2,800	3,472	460,726	2023/01/31
SPAIN 0.05 01/31/21	国債証券	0.0500	400	400	53,113	2021/01/31
SPAIN 1.4 01/31/20	国債証券	1.4000	400	412	54,704	2020/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	2,500	2,604	345,535	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	2,700	3,190	423,227	2024/04/30
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.5000	3,600	4,223	560,358	2021/04/30
SPAIN 4.0 04/30/20	国債証券	4.0000	4,000	4,363	578,913	2020/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,600	2,613	346,666	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	2,500	2,634	349,495	2026/04/30
SPAIN 2.75 04/30/19	国債証券	2.7500	1,400	1,452	192,647	2019/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	2,200	2,206	292,778	2022/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	2,500	3,423	454,132	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	2,000	2,866	380,232	2040/07/30

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	2,100	2,955	392,153	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	950	1,077	142,960	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	2,600	3,270	433,885	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	2,700	2,736	363,098	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	2,400	3,557	471,937	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,000	1,031	136,782	2033/07/30
SPAIN 4.6 07/30/19	国債証券	4.6000	4,100	4,391	582,670	2019/07/30
SPAIN 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	1,700	1,738	230,676	2021/07/30
SPAIN 1.15 07/30/20	国債証券	1.1500	2,100	2,163	287,093	2020/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	2,700	3,027	401,656	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	2,100	2,821	374,308	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,500	2,249	298,491	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,800	1,899	252,062	2046/10/31
SPAIN 4.85 10/31/20	国債証券	4.8500	2,900	3,283	435,602	2020/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	2,600	2,793	370,584	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,400	1,390	184,512	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	2,600	2,590	343,634	2026/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	2,300	2,783	369,245	2023/10/31
SPAIN 4.3 10/31/19	国債証券	4.3000	4,200	4,525	600,431	2019/10/31
小計	—	—	83,630	97,575	12,945,318	—
<b>(ユーロ…イタリア)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	国債証券	4.5000	4,500	4,898	649,898	2020/02/01
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	2,400	3,342	443,478	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	3,500	4,137	548,948	2037/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,650	1,537	203,954	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	250	264	35,095	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	3,700	4,393	582,874	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	1,400	1,246	165,381	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	2,400	2,954	391,963	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	国債証券	4.5000	5,100	5,356	710,623	2019/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	4,400	5,175	686,604	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	2,900	3,495	463,730	2026/03/01
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	国債証券	4.2500	4,600	5,004	663,925	2020/03/01
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国債証券	3.7500	3,300	3,652	484,542	2021/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	2,800	2,530	335,717	2032/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	2,950	3,292	436,834	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	2,500	2,502	331,973	2023/03/15
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	2,500	2,572	341,323	2022/04/15
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	3,700	5,182	687,574	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,650	218,910	2023/05/01
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	国債証券	3.7500	2,300	2,552	338,614	2021/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	600	618	82,109	2024/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,500	1,473	195,502	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	2,500	2,480	329,131	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	2,800	2,843	377,271	2027/06/01
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	3,200	3,570	473,663	2021/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	2,800	3,675	487,673	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	3,000	3,990	529,353	2039/08/01

銘柄	当	期				末						
		種	利	率	額		価		額	償還年月日		
							外	建			金	額
<b>(ユーロ…イタリア)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円						
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国	債	証	券	4.7500	1,900	2,275		301,857			2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国	債	証	券	2.0500	1,300	1,299		172,346			2027/08/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国	債	証	券	4.7500	2,050	2,668		354,063			2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国	債	証	券	3.2500	2,000	2,073		275,080			2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国	債	証	券	4.7500	2,400	2,970		394,045			2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国	債	証	券	5.0000	2,750	3,647		483,963			2040/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国	債	証	券	4.7500	3,900	4,495		596,421			2021/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国	債	証	券	2.4500	1,100	1,077		142,984			2033/09/01
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国	債	証	券	4.0000	3,700	4,066		539,476			2020/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国	債	証	券	3.7500	1,900	2,178		288,989			2024/09/01
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	国	債	証	券	4.2500	6,400	6,837		907,148			2019/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国	債	証	券	5.5000	3,900	4,726		627,078			2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国	債	証	券	2.2500	1,500	1,395		185,194			2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国	債	証	券	1.4500	1,500	1,546		205,144			2022/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国	債	証	券	0.6500	2,100	2,047		271,680			2023/10/15
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国	債	証	券	9.0000	1,900	2,724		361,523			2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国	債	証	券	7.2500	1,800	2,574		341,516			2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国	債	証	券	6.5000	3,300	4,593		609,432			2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国	債	証	券	5.2500	3,500	4,552		604,019			2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国	債	証	券	5.5000	2,500	3,039		403,260			2022/11/01
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	国	債	証	券	0.6500	3,600	3,651		484,441			2020/11/01
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	国	債	証	券	0.3500	1,700	1,696		225,056			2021/11/01
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国	債	証	券	2.0000	2,700	2,751		364,982			2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国	債	証	券	1.2500	2,000	1,893		251,189			2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国	債	証	券	2.5000	4,000	4,265		565,885			2024/12/01
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国	債	証	券	2.1500	2,200	2,337		310,116			2021/12/15
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	国	債	証	券	1.0500	2,000	2,042		271,028			2019/12/01
小計	-	-	-	144,250	163,824	21,734,606						-
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円						
FINLAND 2.0 04/15/24	国	債	証	券	2.0000	680	747		99,193			2024/04/15
FINLAND 3.5 04/15/21	国	債	証	券	3.5000	700	782		103,756			2021/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国	債	証	券	0.7500	450	430		57,150			2031/04/15
FINLAND 3.375 04/15/20	国	債	証	券	3.3750	980	1,060		140,641			2020/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国	債	証	券	0.5000	600	592		78,626			2026/04/15
FINLAND 1.5 04/15/23	国	債	証	券	1.5000	1,150	1,227		162,853			2023/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国	債	証	券	4.0000	800	999		132,659			2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国	債	証	券	2.7500	630	747		99,192			2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国	債	証	券	2.6250	660	834		110,693			2042/07/04
FINLAND 4.375 07/04/19	国	債	証	券	4.3750	620	662		87,840			2019/07/04
FINLAND 0.875 09/15/25	国	債	証	券	0.8750	300	306		40,685			2025/09/15
FINLAND 1.625 09/15/22	国	債	証	券	1.6250	400	428		56,905			2022/09/15
FINLAND 09/15/23	国	債	証	券	-	230	226		30,052			2023/09/15
FINLAND 0.375 09/15/20	国	債	証	券	0.3750	500	509		67,554			2020/09/15
小計	-	-	-	8,700	9,556	1,267,806						-
<b>(ユーロ…オーストリア)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円						
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国	債	証	券	3.8000	820	1,353		179,624			2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国	債	証	券	1.5000	230	225		29,902			2047/02/20
AUSTRIA 4.35 03/15/19	国	債	証	券	4.3500	1,050	1,104		146,550			2019/03/15

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	1,300	1,738	230,597	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	1,650	2,432	322,666	2037/03/15
AUSTRIA 3.65 04/20/22	国債証券	3.6500	1,200	1,382	183,458	2022/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	900	1,047	138,939	2034/05/23
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	810	1,104	146,540	2044/06/20
AUSTRIA 1.95 06/18/19	国債証券	1.9500	1,400	1,446	191,872	2019/06/18
AUSTRIA 3.9 07/15/20	国債証券	3.9000	1,700	1,873	248,622	2020/07/15
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	1,150	1,721	228,347	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	-	350	345	45,798	2023/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	1,900	2,147	284,842	2021/09/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	100	104	13,839	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	1,250	1,349	179,059	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,300	1,300	172,534	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	1,000	1,045	138,763	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	1,400	1,516	201,209	2023/10/20
AUSTRIA 0.25 10/18/19	国債証券	0.2500	250	253	33,594	2019/10/18
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	400	342	45,447	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	1,500	1,736	230,415	2022/11/22
小 計	-	-	21,660	25,571	3,392,630	-
合 計	-	-	-	-	212,805,760	-

## ■投資信託財産の構成

2018年2月21日現在

項 目	期 間	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
公 社 債	212,805,760	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,129,614	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	217,935,374	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、217,710,466千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2018年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.54円、1カナダ・ドル=85.03円、1オーストラリア・ドル=84.86円、1シンガポール・ドル=81.56円、1イギリス・ポンド=150.59円、1スイス・フラン=114.92円、1デンマーク・クローネ=17.81円、1ノルウェー・クローネ=13.72円、1スウェーデン・クローナ=13.28円、1メキシコ・ペソ=5.75円、1マレーシア・リングギット=27.53円、1南アフリカ・ランド=9.17円、1ポーランド・ズロチ=31.97円、1ユーロ=132.67円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	218,310,227,233円
コ ー ル ・ 公 司 等	3,270,760,374
未 収 入 金	212,805,760,129
未 収 利 息	374,880,520
前 払 費 用	1,828,216,079
(B) 負 債	447,097,960
未 払 金	374,852,960
未 払 解 約 金	72,245,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	217,863,129,273
元 本	121,875,729,918
次 期 繰 越 損 益 金	95,987,399,355
(D) 受 益 権 総 口 数	121,875,729,918口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	17,876円

(注1) 期首元本額 143,106,772,360円  
 追加設定元本額 24,631,114,274円  
 一部解約元本額 45,862,156,716円

(注2) 期末における元本の内訳  
 D I AM外国債券パッシブ・ファンド 8,180,656,532円  
 M I T O ラップ型ファンド (安定型) 16,550,949円  
 M I T O ラップ型ファンド (中立的型) 44,049,919円  
 M I T O ラップ型ファンド (積極型) 50,607,050円  
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 84,070,384円  
 グローバル8資産ラップファンド (中立的型) 72,228,889円  
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 35,964,363円  
 たわらノーロード 先進国債券 1,535,100,824円  
 たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け> 606,412円  
 たわらノーロード バランス (8資産均等型) 18,990,483円  
 たわらノーロード バランス (堅実型) 148,917円  
 たわらノーロード バランス (標準型) 1,062,375円  
 たわらノーロード バランス (積極型) 485,021円  
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) 27,649円  
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) 479,499円  
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) 494,676円  
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) 133,194円  
 たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 56,026円  
 たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 331,864円  
 たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 181,560円  
 たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 255,754円  
 D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金> 5,036,271,157円  
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 474,597,820円  
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 1,515,570,262円  
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 1,682,020,108円  
 D I AM DCバランス30インデックスファンド 366,252,324円  
 D I AM DCバランス50インデックスファンド 780,311,672円  
 D I AM DCバランス70インデックスファンド 633,352,049円  
 マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 23,441,361円  
 マネックス資産設計ファンド (育成型) 585,178,050円  
 マネックス資産設計ファンド エポリューション 6,898,943円  
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 17,867,916円  
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 39,193,230円  
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 71,081,407円  
 クルーズコントロール 471,522,151円  
 D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金> 67,264,964円

D I AM DC バランス・F (成長型) 119,784,654円  
 クルーズコントロール<DC年金> 175,031円  
 D I AMコア資産設計ファンド (堅実型) 1,547,650円  
 D I AMコア資産設計ファンド (積極型) 4,761,061円  
 ダイナミック・ナビゲーション 116,328円  
 D I AMパッシブ資産分散ファンド 1,427,367,462円  
 D I AM海唇フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) 6,984,591,409円  
 D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け) 4,074,076,473円  
 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) 3,765,907,771円  
 先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) 576,382,992円  
 D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) 107,448,126円  
 D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 971,191,594円  
 D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 712,187,045円  
 D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 57,495,581円  
 D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 107,057,634円  
 D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 26,555,966円  
 D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 12,520,379円  
 D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 72,192,093円  
 D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 85,457,559円  
 D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 3,803,080,276円  
 D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 2,505,827,352円  
 D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 4,224,822,451円  
 D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) 766,253,872円  
 D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) 516,627,848円  
 D I AMアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 3,600,829,521円  
 D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) 9,268,529,264円  
 D I AMグローバルβ私募ファンド (適格機関投資家向け) 13,975,529円  
 D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 85,144,612円  
 D I AM世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定) 3,043,371,686円  
 D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 15,217,078,121円  
 D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 19,907,287,350円  
 D I AMバランス30VA (適格機関投資家限定) 2,361,904円  
 D I AMバランス50VA (適格機関投資家限定) 34,508,457円  
 D I AMバランス70VA (適格機関投資家限定) 5,621,656円  
 D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定) 17,709,441,950円  
 D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 107,909,809円  
 D I AMバランス20VA (適格機関投資家限定) 83,137,353円  
 D I AMバランス40VA (適格機関投資家限定) 59,633,095円  
 D I AMバランス60VA (適格機関投資家限定) 165,250円  
 期末元本合計 121,875,729,918円

## ■損益の状況

当期 自2017年2月22日 至2018年2月21日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		6,396,523,685円
受 取 利 息		6,397,013,677
支 払 利 息		△489,992
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		1,702,540,323
売 買 益		12,881,740,776
売 買 損		△11,179,200,453
(C) そ の 他 費 用		△27,989,199
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		8,071,074,809
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		105,378,243,251
(F) 解 約 差 損 益 金		△37,173,122,431
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		19,711,203,726
(H) 合 計(D + E + F + G)		95,987,399,355
次 期 繰 越 損 益 金(H)		95,987,399,355

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

## 《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)