

運用報告書 (全体版)

第9期<決算日2019年5月8日>

MHAM外国債券インデックスファンド

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	2010年11月19日から無期限です。	
運用方針	F T S E世界国債インデックス (除く日本) に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の動きに連動する投資成果を目指します。 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。	
主要投資対象	MHAM外国債券インデックスファンド	MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	MHAM外国債券インデックスマザーファンド	F T S E世界国債インデックス (除く日本) に採用されている国・地域の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	MHAM外国債券インデックスファンド	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	MHAM外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎年原則として5月8日に決算を行い、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。	

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、「MHAM外国債券インデックスファンド」は、2019年5月8日に第9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/>

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、ヘッジなし・円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
5期(2015年5月8日)	15,203	0	10.3	464.30	11.7	97.6	-	121
6期(2016年5月9日)	13,951	0	△ 8.2	428.65	△ 7.7	97.5	-	83
7期(2017年5月8日)	14,108	0	1.1	439.54	2.5	98.1	-	96
8期(2018年5月8日)	14,190	0	0.6	447.08	1.7	96.7	-	87
9期(2019年5月8日)	14,306	0	0.8	454.86	1.7	97.7	-	89

(注1) 基準価額は1万口当たり (以下同じ)。

(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

(注3) ベンチマークは、基準価額への反映を考慮して前営業日 (現地ベース) の値を用いております。小数点第3位を四捨五入しています (以下同じ)。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、債券組入比率および債券先物比率は実質比率を記載しております (以下同じ)。

(注5) 債券先物比率は買建比率-売建比率 (以下同じ)。

(注6) 純資産総額の単位未満は切捨て。

(注7) FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率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。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)。

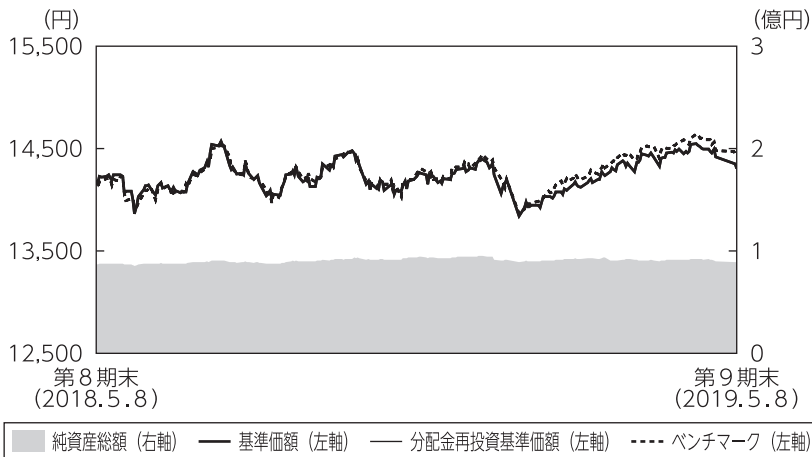
当期中の基準価額と市況推移

	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)2018年5月8日	円	%	ポイント	%	%	%
	14,190	-	447.08	-	96.7	-
第9期	5月末	△1.7	439.03	△1.8	97.4	-
	6月末	△0.3	444.97	△0.5	97.5	-
	7月末	0.4	448.91	0.4	97.1	-
	8月末	0.3	449.73	0.6	96.9	-
	9月末	1.9	455.63	1.9	98.1	-
	10月末	△0.0	446.44	△0.1	98.4	-
	11月末	0.8	451.15	0.9	97.2	-
	12月末	0.1	447.21	0.0	58.1	-
	2019年1月末	△0.7	447.56	0.1	96.4	-
	2月末	0.6	452.77	1.3	97.0	-
	3月末	1.9	456.98	2.2	97.0	-
	4月末	1.6	456.10	2.0	97.8	-
(期末)2019年5月8日	14,306	0.8	454.86	1.7	97.7	-

(注) 騰落率は対期首比。

当期中の運用経過 (2018年5月9日から2019年5月8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はありません。
- (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利用する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 (F T S E 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

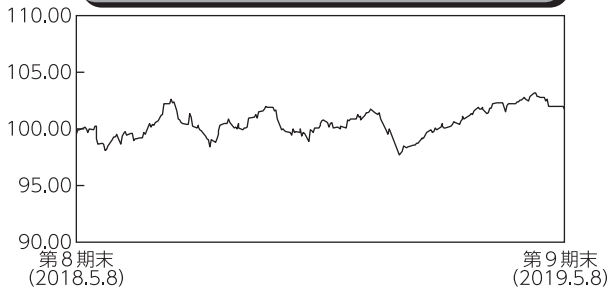
基準価額の主な変動要因

MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、海外債券への投資を行った結果、米国やユーロ圏の債券市況が上昇 (金利は低下) したことが寄与し、基準価額は上昇しました。

投資環境

● 海外債券市場と為替市場

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の推移



(注) 期首を100として指数化しています。

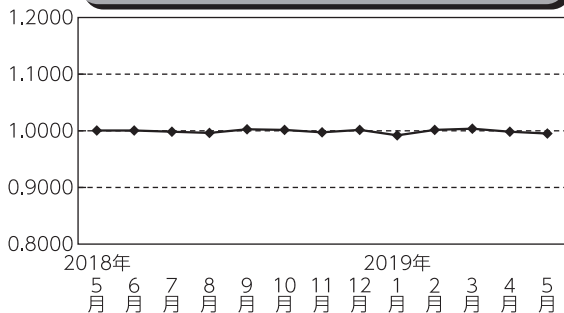
海外債券市場は、上昇しました。期首から10月にかけては、米欧の政治情勢や金融政策の動向などを睨みながら一進一退の展開となりました。11月以降は世界景気の減速懸念の強まりなどを背景に上昇基調で推移しました。米国では、米連邦準備制度理事会（F R B）が金融政策の引き締めにより慎重姿勢を示したことなども上昇要因となりました。欧州では、欧州中央銀行（E C B）のドラギ総裁がユーロ圏の景気が減速する見通しを示したことや、英国の欧州連合（E U）離脱を巡る不透明感なども上昇要因となりました。

為替市場は、まちまちとなりました。米国では、底堅い米国景気やF R Bが追加的に政策金利を引き上げたことなどを背景に米ドルが対円で上昇しました。もっとも2019年1月にはF R Bが金融政策の引き締めにより慎重姿勢を示したことなどから下落し、上げ幅は小幅となりました。欧州では、欧州景気の悪化懸念やイタリアの財政不安などがユーロ安要因となり、ユーロが対円で下落しました。

ポートフォリオについて

● MHAM外国債券インデックスファンド

月間連動率の推移



当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

$$\text{月間連動率} = \frac{1 + \text{基準価額月間騰落率}}{1 + \text{ベンチマーク月間騰落率}}$$

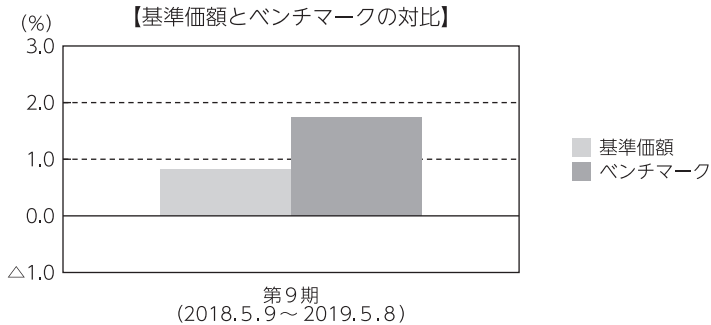
(注) 月間連動率の2018年5月は対期首比、2019年5月は期末対2019年4月末比

●MHAM外国債券インデックスマザーファンド

当期の運用につきましては、当マザーファンドの運用方針に従い、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動した投資成果を目指すため、ポートフォリオの構成を極力ベンチマークに近づけました。また、資金の流出入等に対応するため一部海外の債券先物取引を行っており、先物を含む海外債券の組入比率は期を通じて高位に保ちました。

■ベンチマークとの差異について

MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、海外債券への投資を行った結果、当ファンドの基準価額はベンチマークを0.9%程度下回りました。この差異は主に、ファンドとベンチマークで評価に用いられる為替レートが異なることと、信託報酬によるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

分配金

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2018年5月9日 ～2019年5月8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	4,985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。

(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

●MHAM外国債券インデックスファンド

今後の運用につきましても、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持します。

●MHAM外国債券インデックスマザーファンド

今後の運用につきましても、ポートフォリオの構成を極力、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に近づけ、先物を含む海外債券の組入比率を高位に維持することにより、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

1 万口当たりの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	(2018年5月9日 ～2019年5月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	108円	0.756%	(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14,246円です。
(投信会社)	(38)	(0.270)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(62)	(0.432)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(8)	(0.054)	受託会社分は、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
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(c) 有価証券取引税	－	－	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
			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
(d) その他費用	8	0.057	(d) 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)	(7)	(0.048)	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)	(1)	(0.004)	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)	(1)	(0.005)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用
合計	116	0.814	

(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、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 期中の売買及び取引の状況 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	千口 10,941	千円 13,729	千口 10,460	千円 13,208

(注) 単位未満は切捨て。

■ 利害関係人との取引状況等 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

当期中における利害関係人との取引状況等はありません。

*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をいいます。

■ 組入資産の明細

2019年5月8日現在

親投資信託残高

種 類	期首 (前期末)	当 期		末
	□ 数	□ 数	評 価	額
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	千口 70,035	千口 70,516		千円 89,140

(注) 単位未満は切捨て。

※当期末における親投資信託の組入資産の明細は、15～32頁をご参照ください。

投資信託財産の構成

2019年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	89,140	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	349	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	89,489	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨て。

(注2) MHAM外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（23,051,820千円）の投資信託財産総額（23,270,477千円）に対する比率は99.1%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、2019年5月8日における邦貨換算レートは、1米ドル=110.19円、1カナダドル=81.78円、1メキシコペソ=5.79円、1ユーロ=123.29円、1英ポンド=144.00円、1スウェーデンクローナ=11.48円、1ノルウェークローネ=12.59円、1デンマーククローネ=16.51円、1ポーランドズロチ=28.74円、1オーストラリアドル=77.27円、1シンガポールドル=80.89円、1マレーシアリングギット=26.55円、1南アフリカランド=7.64円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

2019年5月8日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	89,489,180円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	348,857
MHAM外国債券インデックス マザーファンド（評価額）	89,140,323
(B) 負 債	346,364
未 払 信 託 報 酬	344,699
そ の 他 未 払 費 用	1,665
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	89,142,816
元 本	62,312,759
次 期 繰 越 損 益 金	26,830,057
(D) 受 益 権 総 口 数	62,312,759口
1万口当たり基準価額 (C/D)	14,306円

(注1) 当期末における1口当たり純資産額 1.4306円

(注2) その他未払費用 監査費用等を計上しています。

(注3) 期首元本額 61,555,802円

期中追加設定元本額 10,450,632円

期中一部解約元本額 9,693,675円

損益の状況

(2018年5月9日から2019年5月8日まで)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 26円
支 払 利 息	△ 26
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,344,681
売 買 益	1,634,886
売 買 損	△ 290,205
(C) 信 託 報 酬 等	△ 689,775
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	654,880
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,561,022
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	23,614,155
(配 当 等 相 当 額)	(20,998,265)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,615,890)
(G) 計 算 (D + E + F)	26,830,057
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	26,830,057
追 加 信 託 差 損 益 金	23,614,155
(配 当 等 相 当 額)	(21,026,681)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,587,474)
分 配 準 備 積 立 金	10,041,532
繰 越 損 益 金	△ 6,825,630

(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。

※本運用報告書作成時点においては、当計算期間に係る当ファンドの監査は終了しておりません。

－ 運用報告書（全体版） －

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

第11期

決算日：2019年5月8日

(計算期間：2018年5月9日～2019年5月8日)

「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」は、2019年5月8日に第11期決算を行いました。

ここに当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

■マザーファンドの仕組み

信託期間	2008年6月3日から無期限です。
運用方針	F T S E世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。 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。
投資対象	F T S E世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	期中 騰落率	騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
7期(2015年5月8日)	13,032	11.4	464.30	11.7	97.6	—	11,652
8期(2016年5月9日)	12,050	△ 7.5	428.65	△ 7.7	97.5	—	22,909
9期(2017年5月8日)	12,279	1.9	439.54	2.5	98.1	—	11,560
10期(2018年5月8日)	12,444	1.3	447.08	1.7	96.9	—	15,932
11期(2019年5月8日)	12,641	1.6	454.86	1.7	97.7	—	23,076

(注1) 基準価額は1万円当たり(以下同じ)。

(注2) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

(注3) ベンチマークは、基準価額への反映を考慮して前営業日(現地ベース)の値を用いております。小数点第3位を四捨五入しています(以下同じ)。

(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率(以下同じ)。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

(注6) FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率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。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)。

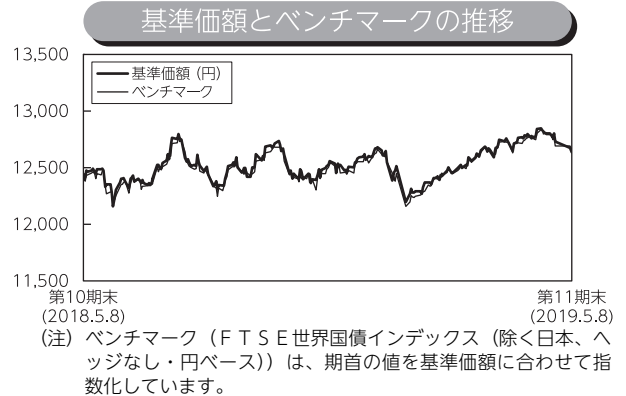
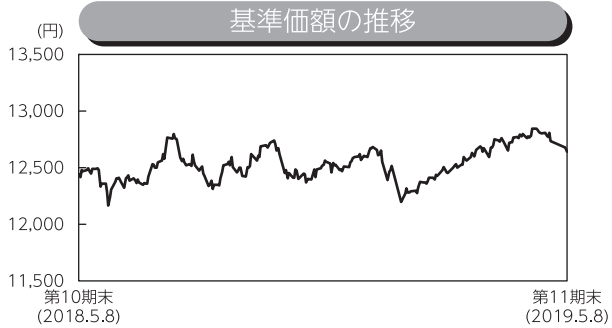
当期中の基準価額と市況推移

	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	
	騰落率	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(期首)2018年5月8日	円	%	ポイント	%	%	%	
	12,444	—	447.08	—	96.9	—	
第 11 期	5月末	12,236	△1.7	439.03	△1.8	97.4	—
	6月末	12,422	△0.2	444.97	△0.5	97.5	—
	7月末	12,516	0.6	448.91	0.4	97.1	—
	8月末	12,505	0.5	449.73	0.6	97.0	—
	9月末	12,717	2.2	455.63	1.9	98.1	—
	10月末	12,486	0.3	446.44	△0.1	98.4	—
	11月末	12,594	1.2	451.15	0.9	97.2	—
	12月末	12,514	0.6	447.21	0.0	58.2	—
	2019年1月末	12,426	△0.1	447.56	0.1	96.4	—
	2月末	12,601	1.3	452.77	1.3	97.0	—
	3月末	12,767	2.6	456.98	2.2	97.0	—
4月末	12,734	2.3	456.10	2.0	97.8	—	
(期末)2019年5月8日	12,641	1.6	454.86	1.7	97.7	—	

(注) 騰落率は対期首比。

当期中の運用経過 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

【基準価額等の推移】



【基準価額の主な変動要因】

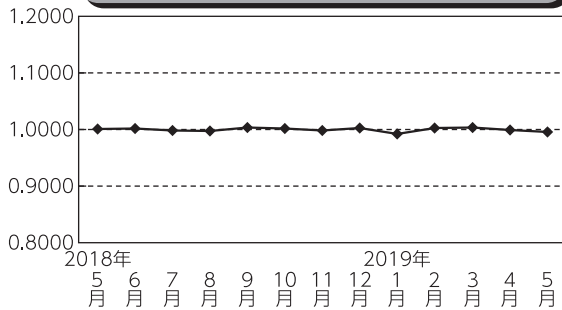
米国やユーロ圏の債券市況が上昇 (金利は低下) したことが寄与し、基準価額は上昇しました。

【投資環境】

3頁をご参照ください。

【ポートフォリオ】

月間連動率の推移



4頁をご参照ください。

$$\text{月間連動率} = \frac{1 + \text{基準価額月間騰落率}}{1 + \text{ベンチマーク月間騰落率}}$$

(注) 月間連動率の2018年5月は対期首比、2019年5月は期末対2019年4月末比

【ベンチマークとの差異】

当ファンドの基準価額はベンチマークを0.2%程度下回りました。この差異は主に、ファンドとベンチマークで評価に用いられる為替レートが異なることによるものです。

今後の運用方針

5頁をご参照ください。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2018年5月9日~2019年5月8日)		
	金額 (円)	比率 (%)	
平均基準価額	12,543	-	-
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0 (0)	0.001 (0.001)	(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) その他費用 (保管費用) (その他)	7 (6) (1)	0.052 (0.047) (0.005)	(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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用
合計	7	0.053	

(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。

(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。

期中の売買及び取引の状況 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

(1) 公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 115,318	千米ドル 82,553
	カナダ	国債証券	千カナダドル 5,265	千カナダドル 4,047
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 36,176	千メキシコペソ 25,006
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	12,527	8,947
	イタリア	国債証券	16,129	12,607
	フランス	国債証券	20,670	15,275
	オランダ	国債証券	5,186	3,715
	スペイン	国債証券	10,889	7,332
	ベルギー	国債証券	5,912	4,110
国	オーストリア	国債証券	3,102	2,244
	フィンランド	国債証券	1,378	1,235
	アイルランド	国債証券	1,597	1,605
	イギリス	国債証券	千英ポンド 11,568	千英ポンド 8,800

			買付額	売付額
外 国	ス イ ス	国債証券	千スイスフラン -	千スイスフラン 158
	ス ウ ェ ー デ ン	国債証券	千スウェーデンクローナ 7,255	千スウェーデンクローナ 5,997
	ノ ル ウ ェ ー	国債証券	千ノルウェークローネ 4,876	千ノルウェークローネ 4,091
	デ ン マ ー ク	国債証券	千デンマーククローネ 8,256	千デンマーククローネ 6,730
	ポ ー ラ ン ド	国債証券	千ポーランドズロチ 5,515	千ポーランドズロチ 4,057
	オ ー ス ト ラ リ ア	国債証券	千オーストラリアドル 6,228	千オーストラリアドル 4,634
	シ ン ガ ポ ー ル	国債証券	千シンガポールドル 1,032	千シンガポールドル 634
	マ レ ー シ ア	国債証券	千マレーシアリンギット 2,060	千マレーシアリンギット 801
	南 ア フ リ カ	国債証券	千南アフリカランド 16,385	千南アフリカランド 11,317

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	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 3,117	百万円 3,114	百万円 -	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

当期中における利害関係人との取引状況等はありません。

(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をいいます。

組入資産の明細

2019年5月8日現在

外国（外貨建）公社債

A 種類別開示

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	
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%	
ア メ リ カ	95,520	96,682	10,653,427	46.2	—	19.1	18.2	8.9	
カ ナ ダ	千カナダドル 4,885	千カナダドル 5,258	430,061	1.9	—	0.8	0.5	0.5	
メ キ シ コ	千メキシコペソ 32,161	千メキシコペソ 31,575	182,823	0.8	—	0.4	0.3	—	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ							
ド イ ツ	10,280	12,140	1,496,846	6.5	—	3.6	1.8	1.1	
イ タ リ ア	13,752	14,896	1,836,542	8.0	—	5.3	1.9	0.7	
フ ラ ン ス	14,875	17,959	2,214,285	9.6	—	6.3	2.3	0.9	
オ ラ ン ダ	3,670	4,260	525,308	2.3	—	1.3	0.9	0.1	
ス ペ イ ン	9,125	10,881	1,341,638	5.8	—	3.9	1.3	0.6	
ベルギー	4,120	5,006	617,231	2.7	—	1.8	0.8	0.1	
オーストリア	2,610	2,979	367,295	1.6	—	0.9	0.3	0.4	
フィンランド	1,050	1,137	140,186	0.6	—	0.4	0.2	—	
アイルランド	1,070	1,202	148,313	0.6	—	0.4	0.2	0.0	
イ ギ リ ス	千英ポンド 8,184	千英ポンド 10,275	1,479,629	6.4	—	4.8	1.3	0.3	
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 5,210	千スウェーデンクローナ 5,975	68,594	0.3	—	0.2	0.1	—	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 3,410	千ノルウェークローネ 3,508	44,169	0.2	—	0.1	0.1	—	
デンマーク	千デンマーククローネ 5,320	千デンマーククローネ 6,888	113,734	0.5	—	0.3	0.2	—	
ポーランド	千ポーランドズロチ 4,260	千ポーランドズロチ 4,360	125,310	0.5	—	0.2	0.3	—	
オーストラリア	千オーストラリアドル 5,325	千オーストラリアドル 5,911	456,797	2.0	—	1.3	0.6	0.1	
シンガポール	千シンガポールドル 1,030	千シンガポールドル 1,075	86,970	0.4	—	0.2	0.2	—	
マレーシア	千マレーシアリンギット 3,590	千マレーシアリンギット 3,608	95,812	0.4	—	0.4	—	—	
南アフリカ	千南アフリカランド 17,880	千南アフリカランド 15,958	121,921	0.5	—	0.5	—	—	
合 計	—	—	22,546,902	97.7	—	52.4	31.7	13.6	

(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。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(注4) ー印は組入れなし。

(注5) 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

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	%	千米ドル	千米ドル	千円	
		US TREASURY N/B	1.125	140	138	15,238	2020/4/30
		US TREASURY N/B	1.125	220	215	23,730	2021/2/28
		US TREASURY N/B	1.125	340	331	36,574	2021/6/30
		US TREASURY N/B	1.125	140	136	15,042	2021/7/31
		US TREASURY N/B	1.125	380	370	40,791	2021/8/31
		US TREASURY N/B	1.125	40	38	4,290	2021/9/30
		US TREASURY N/B	1.25	2,140	2,098	231,237	2021/3/31
		US TREASURY N/B	1.25	300	292	32,253	2021/10/31
		US TREASURY N/B	1.25	150	143	15,855	2023/7/31
		US TREASURY N/B	1.375	300	297	32,726	2020/4/30
		US TREASURY N/B	1.375	300	296	32,700	2020/5/31
		US TREASURY N/B	1.375	250	246	27,194	2020/8/31
		US TREASURY N/B	1.375	190	187	20,648	2020/9/30
		US TREASURY N/B	1.375	610	601	66,249	2020/10/31
		US TREASURY N/B	1.375	110	108	11,924	2021/1/31
		US TREASURY N/B	1.375	160	157	17,317	2021/4/30
		US TREASURY N/B	1.375	310	304	33,526	2021/5/31
		US TREASURY N/B	1.375	370	357	39,343	2023/6/30
		US TREASURY N/B	1.375	170	163	18,056	2023/8/31
		US TREASURY N/B	1.375	230	221	24,398	2023/9/30
		US TREASURY N/B	1.5	100	99	10,918	2020/5/15
		US TREASURY N/B	1.5	250	247	27,291	2020/5/31
		US TREASURY N/B	1.5	210	205	22,684	2022/1/31
		US TREASURY N/B	1.5	240	233	25,722	2023/2/28
		US TREASURY N/B	1.5	440	427	47,112	2023/3/31
		US TREASURY N/B	1.5	1,030	970	106,934	2026/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	250	247	27,308	2020/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	270	267	29,479	2020/7/31
		US TREASURY N/B	1.625	280	276	30,510	2020/11/30
		US TREASURY N/B	1.625	150	147	16,206	2022/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	1,070	1,048	115,582	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	230	225	24,815	2022/11/15
		US TREASURY N/B	1.625	320	312	34,420	2023/4/30
		US TREASURY N/B	1.625	230	224	24,731	2023/5/31
		US TREASURY N/B	1.625	300	291	32,124	2023/10/31
		US TREASURY N/B	1.625	610	582	64,175	2026/2/15
		US TREASURY N/B	1.625	1,040	990	109,181	2026/5/15
		US TREASURY N/B	1.75	200	198	21,845	2020/10/31
		US TREASURY N/B	1.75	140	138	15,281	2020/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	160	158	17,410	2021/11/30
		US TREASURY N/B	1.75	200	197	21,747	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.75	180	177	19,553	2022/4/30

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
		千米ドル	千米ドル	千円			
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.75	250	246	27,155	2022/5/15
		US TREASURY N/B	1.75	290	285	31,488	2022/5/31
		US TREASURY N/B	1.75	260	256	28,237	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	210	206	22,771	2022/9/30
		US TREASURY N/B	1.75	260	255	28,141	2023/1/31
		US TREASURY N/B	1.75	390	382	42,138	2023/5/15
		US TREASURY N/B	1.875	120	119	13,146	2020/6/30
		US TREASURY N/B	1.875	250	248	27,351	2020/12/15
		US TREASURY N/B	1.875	250	247	27,293	2021/11/30
		US TREASURY N/B	1.875	370	366	40,365	2022/1/31
		US TREASURY N/B	1.875	320	316	34,897	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.875	1,340	1,325	146,052	2022/3/31
		US TREASURY N/B	1.875	200	197	21,802	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.875	100	98	10,900	2022/5/31
		US TREASURY N/B	1.875	290	286	31,595	2022/7/31
		US TREASURY N/B	1.875	210	207	22,870	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1.875	960	948	104,551	2022/9/30
		US TREASURY N/B	1.875	200	197	21,765	2022/10/31
		US TREASURY N/B	1.875	120	117	12,959	2024/8/31
		US TREASURY N/B	2.0	210	209	23,036	2020/7/31
		US TREASURY N/B	2.0	150	149	16,444	2020/9/30
		US TREASURY N/B	2.0	180	179	19,736	2020/11/30
		US TREASURY N/B	2.0	110	109	12,055	2021/1/15
		US TREASURY N/B	2.0	300	298	32,878	2021/2/28
		US TREASURY N/B	2.0	120	119	13,148	2021/5/31
		US TREASURY N/B	2.0	210	208	23,004	2021/8/31
		US TREASURY N/B	2.0	210	208	22,995	2021/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	360	357	39,429	2021/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	190	188	20,810	2021/12/31
		US TREASURY N/B	2.0	250	248	27,375	2022/2/15
		US TREASURY N/B	2.0	250	248	27,340	2022/7/31
		US TREASURY N/B	2.0	320	317	34,968	2022/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	1,430	1,417	156,229	2022/11/30
		US TREASURY N/B	2.0	390	386	42,584	2023/2/15
		US TREASURY N/B	2.0	160	157	17,384	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.0	130	128	14,142	2024/5/31
		US TREASURY N/B	2.0	90	88	9,778	2024/6/30
		US TREASURY N/B	2.0	650	639	70,442	2025/2/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,130	1,108	122,111	2025/8/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,110	1,081	119,157	2026/11/15
US TREASURY N/B	2.125	210	209	23,065	2020/8/31		
US TREASURY N/B	2.125	200	199	21,965	2021/1/31		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	190	189	20,869	2021/6/30
		US TREASURY N/B	2.125	280	279	30,759	2021/8/15
		US TREASURY N/B	2.125	250	249	27,450	2021/9/30
		US TREASURY N/B	2.125	250	249	27,463	2021/12/31
		US TREASURY N/B	2.125	220	219	24,158	2022/6/30
		US TREASURY N/B	2.125	400	398	43,896	2022/12/31
		US TREASURY N/B	2.125	260	258	28,463	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.125	150	149	16,421	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.125	760	754	83,107	2024/3/31
		US TREASURY N/B	2.125	180	178	19,688	2024/7/31
		US TREASURY N/B	2.125	180	178	19,669	2024/9/30
		US TREASURY N/B	2.125	180	178	19,669	2024/11/30
		US TREASURY N/B	2.125	1,270	1,255	138,366	2025/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	90	89	9,906	2021/2/15
		US TREASURY N/B	2.25	170	169	18,714	2021/3/31
		US TREASURY N/B	2.25	180	179	19,817	2021/4/30
		US TREASURY N/B	2.25	300	299	33,041	2021/7/31
		US TREASURY N/B	2.25	280	279	30,824	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.25	160	159	17,605	2024/1/31
		US TREASURY N/B	2.25	250	249	27,498	2024/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	420	419	46,171	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.25	220	219	24,196	2024/12/31
		US TREASURY N/B	2.25	1,220	1,213	133,707	2025/11/15
		US TREASURY N/B	2.25	490	485	53,465	2027/2/15
		US TREASURY N/B	2.25	690	681	75,146	2027/8/15
		US TREASURY N/B	2.25	810	799	88,110	2027/11/15
		US TREASURY N/B	2.25	300	265	29,237	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	190	189	20,931	2020/4/30
		US TREASURY N/B	2.375	200	200	22,056	2020/12/31
		US TREASURY N/B	2.375	300	300	33,098	2021/3/15
		US TREASURY N/B	2.375	230	230	25,377	2021/4/15
		US TREASURY N/B	2.375	340	341	37,628	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.375	170	170	18,837	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.375	580	582	64,214	2024/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	460	459	50,631	2027/5/15
		US TREASURY N/B	2.5	290	290	31,992	2020/5/31
		US TREASURY N/B	2.5	1,110	1,111	122,463	2020/6/30
		US TREASURY N/B	2.5	560	563	62,096	2022/1/15
		US TREASURY N/B	2.5	1,190	1,198	132,017	2022/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	330	333	36,703	2023/3/31
		US TREASURY N/B	2.5	300	303	33,387	2023/8/15
		US TREASURY N/B	2.5	690	696	76,702	2024/1/31

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.5	1,270	1,283	141,460	2024/5/15
		US TREASURY N/B	2.5	220	222	24,514	2025/1/31
		US TREASURY N/B	2.5	620	580	63,925	2045/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	610	569	62,731	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	290	270	29,785	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.625	540	541	59,679	2020/7/31
		US TREASURY N/B	2.625	3,720	3,731	411,219	2020/8/31
		US TREASURY N/B	2.625	2,460	2,470	272,210	2020/11/15
		US TREASURY N/B	2.625	290	291	32,162	2021/5/15
		US TREASURY N/B	2.625	1,020	1,027	113,192	2021/6/15
		US TREASURY N/B	2.625	230	231	25,529	2021/7/15
		US TREASURY N/B	2.625	1,450	1,464	161,323	2021/12/15
		US TREASURY N/B	2.625	250	253	27,921	2023/2/28
		US TREASURY N/B	2.625	230	233	25,715	2023/6/30
		US TREASURY N/B	2.625	470	477	52,618	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.625	240	244	26,904	2025/3/31
		US TREASURY N/B	2.625	310	315	34,756	2025/12/31
		US TREASURY N/B	2.625	370	374	41,292	2026/1/31
		US TREASURY N/B	2.625	750	761	83,901	2029/2/15
		US TREASURY N/B	2.75	430	432	47,629	2020/9/30
		US TREASURY N/B	2.75	230	231	25,502	2020/11/30
		US TREASURY N/B	2.75	200	202	22,270	2021/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,220	2,245	247,392	2021/9/15
		US TREASURY N/B	2.75	230	234	25,818	2023/4/30
		US TREASURY N/B	2.75	1,190	1,213	133,717	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.75	1,160	1,183	130,406	2023/8/31
		US TREASURY N/B	2.75	1,170	1,194	131,621	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	910	930	102,482	2024/2/15
		US TREASURY N/B	2.75	320	327	36,114	2025/2/28
		US TREASURY N/B	2.75	250	255	28,208	2025/6/30
		US TREASURY N/B	2.75	190	194	21,448	2025/8/31
		US TREASURY N/B	2.75	600	615	67,818	2028/2/15
		US TREASURY N/B	2.75	250	247	27,226	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	506	499	55,037	2042/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	500	488	53,863	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	590	576	63,523	2047/11/15
		US TREASURY N/B	2.875	340	342	37,748	2020/10/31
		US TREASURY N/B	2.875	220	223	24,590	2021/10/15
		US TREASURY N/B	2.875	340	345	38,029	2021/11/15
		US TREASURY N/B	2.875	1,180	1,210	133,366	2023/9/30
		US TREASURY N/B	2.875	1,120	1,149	126,633	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.875	870	893	98,456	2023/11/30

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円			
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	330	340	37,501	2025/4/30
		US TREASURY N/B	2.875	380	391	43,187	2025/5/31
		US TREASURY N/B	2.875	240	247	27,278	2025/7/31
		US TREASURY N/B	2.875	650	670	73,923	2025/11/30
		US TREASURY N/B	2.875	1,070	1,108	122,149	2028/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	1,050	1,087	119,884	2028/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	570	573	63,245	2043/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	370	371	40,970	2045/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	260	261	28,770	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	160	166	18,324	2025/9/30
		US TREASURY N/B	3.0	150	155	17,183	2025/10/31
		US TREASURY N/B	3.0	110	113	12,518	2042/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	600	617	67,999	2044/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	570	586	64,633	2045/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	360	370	40,815	2045/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	310	319	35,154	2047/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	460	472	52,101	2047/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	600	615	67,839	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	630	646	71,241	2048/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	510	523	57,737	2049/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	300	304	33,607	2021/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	960	1,015	111,873	2028/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	105	110	12,211	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	180	189	20,909	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	200	210	23,169	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	550	578	63,701	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	630	661	72,944	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.375	530	580	64,003	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.375	620	683	75,331	2048/11/15
		US TREASURY N/B	3.5	215	217	23,951	2020/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	110	123	13,635	2039/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	270	276	30,423	2021/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	500	569	62,760	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.625	610	695	76,636	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.75	110	127	14,068	2041/8/15
		US TREASURY N/B	3.75	385	447	49,323	2043/11/15
		US TREASURY N/B	3.875	130	153	16,945	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	310	384	42,407	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.25	130	161	17,820	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.375	50	62	6,918	2038/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	90	113	12,518	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.375	340	429	47,322	2040/5/15
		US TREASURY N/B	4.375	100	126	13,952	2041/5/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.5	180	226	24,930	2036/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	60	76	8,436	2038/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	175	224	24,709	2039/8/15
		US TREASURY N/B	4.625	420	547	60,319	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.75	220	292	32,192	2041/2/15
		US TREASURY N/B	5.0	55	73	8,131	2037/5/15
		US TREASURY N/B	5.25	65	80	8,858	2028/11/15
		US TREASURY N/B	5.25	120	149	16,421	2029/2/15
		US TREASURY N/B	5.375	80	103	11,395	2031/2/15
		US TREASURY N/B	5.5	50	62	6,901	2028/8/15
		US TREASURY N/B	6.0	60	73	8,106	2026/2/15
		US TREASURY N/B	6.125	80	102	11,317	2027/11/15
		US TREASURY N/B	6.25	70	81	8,961	2023/8/15
		US TREASURY N/B	6.25	49	66	7,353	2030/5/15
		US TREASURY N/B	6.5	50	64	7,062	2026/11/15
US TREASURY N/B	8.0	35	39	4,392	2021/11/15		
小 計						10,653,427	
カナダ	国債証券	CANADA GOVT	2.75	50	62	5,139	2064/12/1
		CANADIAN GOVT	0.5	110	106	8,733	2022/3/1
		CANADIAN GOVT	0.75	260	256	21,011	2020/9/1
		CANADIAN GOVT	0.75	240	236	19,334	2021/3/1
		CANADIAN GOVT	0.75	240	235	19,264	2021/9/1
		CANADIAN GOVT	1.0	180	176	14,450	2022/9/1
		CANADIAN GOVT	1.0	150	142	11,666	2027/6/1
		CANADIAN GOVT	1.5	100	99	8,158	2023/6/1
		CANADIAN GOVT	1.5	140	138	11,357	2026/6/1
		CANADIAN GOVT	1.75	180	180	14,750	2020/8/1
		CANADIAN GOVT	1.75	160	161	13,178	2023/3/1
		CANADIAN GOVT	2.0	150	150	12,333	2020/11/1
		CANADIAN GOVT	2.0	450	458	37,496	2023/9/1
		CANADIAN GOVT	2.0	330	339	27,759	2028/6/1
		CANADIAN GOVT	2.0	40	40	3,318	2051/12/1
		CANADIAN GOVT	2.25	580	586	47,965	2021/2/1
		CANADIAN GOVT	2.25	70	72	5,911	2024/3/1
		CANADIAN GOVT	2.25	110	114	9,336	2025/6/1
		CANADIAN GOVT	2.25	70	73	6,027	2029/6/1
		CANADIAN GOVT	2.5	120	125	10,261	2024/6/1
		CANADIAN GOVT	2.75	110	113	9,311	2022/6/1
		CANADIAN GOVT	2.75	220	259	21,248	2048/12/1
		CANADIAN GOVT	3.25	85	87	7,186	2021/6/1
CANADIAN GOVT	3.5	190	250	20,500	2045/12/1		
CANADIAN GOVT	4.0	140	191	15,647	2041/6/1		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
カナダ	国債証券	CANADIAN GOVT	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	2037/6/1
		CANADIAN GOVT	5.0	150	220	18,038	2029/6/1
		CANADIAN GOVT	5.75	100	137	11,227	2033/6/1
		CANADIAN GOVT	5.75	120	178	14,613	2027/6/1
		CANADIAN GOVT	8.0	40	59	4,833	
小 計						430,061	
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR	10.0	千メキシコペソ	千メキシコペソ		2024/12/5
		MEX BONOS DESARR	10.0	2,394	2,610	15,114	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR	10.0	911	1,040	6,027	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR	5.75	1,429	1,258	7,288	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR	6.5	5,718	5,545	32,107	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR	6.5	2,434	2,333	13,513	2021/12/9
		MEX BONOS DESARR	7.25	1,510	1,481	8,577	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR	7.5	4,577	4,403	25,496	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR	7.75	705	676	3,916	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR	7.75	915	864	5,003	2042/11/13
		MEX BONOS DESARR	7.75	2,393	2,208	12,789	2023/12/7
		MEX BONOS DESARR	8.0	4,571	4,581	26,525	2047/11/7
		MEX BONOS DESARR	8.0	869	817	4,732	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR	8.5	840	857	4,964	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR	8.5	2,895	2,895	16,765	
小 計						182,823	
ユ ー ロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDES OBLIGATION	-	1,030	1,042	128,511	2021/4/9
		BUNDES OBLIGATION	-	210	213	26,283	2021/10/8
		BUNDES OBLIGATION	-	100	101	12,555	2022/4/8
		BUNDES OBLIGATION	-	170	173	21,419	2023/4/14
		BUNDES OBLIGATION	-	140	143	17,656	2023/10/13
		BUNDES OBLIGATION	0.25	140	141	17,475	2020/10/16
		BUNDES REPUB. DEUT	-	230	234	28,949	2026/8/15
		BUNDES REPUB. DEUT	0.25	600	623	76,829	2027/2/15
		BUNDES REPUB. DEUT	0.25	480	495	61,033	2028/8/15
		BUNDES REPUB. DEUT	0.25	80	82	10,137	2029/2/15
		BUNDES REPUB. DEUT	0.5	240	252	31,168	2025/2/15
		BUNDES REPUB. DEUT	0.5	240	253	31,267	2026/2/15
		BUNDES REPUB. DEUT	0.5	210	222	27,392	2027/8/15
		BUNDES REPUB. DEUT	0.5	230	243	29,972	2028/2/15
		BUNDES REPUB. DEUT	1.0	150	161	19,926	2024/8/15
		BUNDES REPUB. DEUT	1.0	90	97	12,063	2025/8/15
		BUNDES REPUB. DEUT	1.25	170	198	24,476	2048/8/15
		BUNDES REPUB. DEUT	1.5	130	139	17,157	2022/9/4
		BUNDES REPUB. DEUT	1.5	110	118	14,631	2023/2/15
		BUNDES REPUB. DEUT	1.5	120	129	16,026	2023/5/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUT	1.5	130	143	17,633	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUT	1.75	610	655	80,851	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUT	1.75	130	144	17,767	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUT	2.0	170	181	22,435	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUT	2.0	830	920	113,549	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUT	2.25	100	103	12,799	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUT	2.25	120	128	15,790	2021/9/4
		BUNDESREPUB. DEUT	2.5	300	315	38,950	2021/1/4
		BUNDESREPUB. DEUT	2.5	360	524	64,691	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUT	2.5	230	340	42,015	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUT	3.0	200	208	25,689	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUT	3.25	140	151	18,709	2021/7/4
		BUNDESREPUB. DEUT	3.25	250	401	49,497	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUT	4.0	340	554	68,313	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUT	4.25	120	209	25,780	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUT	4.75	100	145	17,883	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUT	4.75	310	519	64,071	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUT	4.75	130	243	30,057	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUT	5.5	240	393	48,510	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUT	5.625	150	226	27,889	2028/1/4
BUNDESREPUB. DEUT	6.25	70	92	11,374	2024/1/4		
BUNDESREPUB. DEUT	6.25	70	117	14,452	2030/1/4		
BUNDESREPUB. DEUT	6.5	70	108	13,413	2027/7/4		
BUNDESSCHATZANW	-	240	241	29,784	2020/6/12		
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	0.2	350	350	43,154	2020/10/15
		BUONI POLIENNALI	0.35	110	110	13,602	2020/6/15
		BUONI POLIENNALI	0.35	70	69	8,559	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI	0.45	60	59	7,390	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI	0.65	100	100	12,401	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI	0.65	110	106	13,141	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI	0.7	70	70	8,684	2020/5/1
		BUONI POLIENNALI	0.9	520	517	63,783	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI	0.95	50	49	6,093	2023/3/1
		BUONI POLIENNALI	0.95	220	217	26,814	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI	1.2	160	161	19,868	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI	1.25	90	85	10,503	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI	1.35	160	161	19,943	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI	1.45	160	161	19,957	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI	1.45	130	126	15,652	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI	1.5	190	186	22,956	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI	1.6	110	107	13,214	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI	1.65	200	177	21,822	2032/3/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	1.85	140	141	17,462	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI	2.0	130	130	16,096	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI	2.0	650	637	78,559	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI	2.05	600	592	73,012	2027/8/1
		BUONI POLIENNALI	2.15	140	144	17,856	2021/12/15
		BUONI POLIENNALI	2.2	220	220	27,131	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI	2.25	170	153	18,947	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI	2.45	50	52	6,420	2023/10/1
		BUONI POLIENNALI	2.45	130	123	15,267	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI	2.5	107	111	13,714	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI	2.5	310	319	39,446	2025/11/15
		BUONI POLIENNALI	2.7	400	356	43,965	2047/3/1
		BUONI POLIENNALI	2.8	140	144	17,809	2028/12/1
		BUONI POLIENNALI	2.8	70	59	7,323	2067/3/1
		BUONI POLIENNALI	2.95	80	77	9,519	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI	3.25	110	108	13,335	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI	3.35	120	124	15,374	2035/3/1
		BUONI POLIENNALI	3.45	130	130	16,133	2048/3/1
		BUONI POLIENNALI	3.5	270	291	35,981	2030/3/1
		BUONI POLIENNALI	3.75	390	413	50,979	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI	3.75	150	159	19,671	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI	3.75	220	235	28,987	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI	3.75	160	176	21,736	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI	3.85	120	126	15,627	2049/9/1
		BUONI POLIENNALI	4.0	180	188	23,299	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI	4.0	540	605	74,665	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI	4.5	120	134	16,608	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI	4.5	380	431	53,151	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI	4.5	180	208	25,689	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI	4.75	180	196	24,244	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI	4.75	190	216	26,667	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI	4.75	180	216	26,652	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI	4.75	170	206	25,501	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI	5.0	155	172	21,269	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI	5.0	990	1,162	143,331	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI	5.0	390	484	59,752	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI	5.0	440	549	67,722	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI	5.0	220	273	33,668	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI	5.25	360	447	55,147	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI	5.5	170	194	23,948	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI	5.5	130	149	18,386	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI	5.75	160	210	26,013	2033/2/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	6.0	310	412	50,866	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI	6.5	300	397	48,955	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI	7.25	60	81	10,006	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI	9.0	80	106	13,083	2023/11/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	150	150	18,600	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	90	90	11,164	2021/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	250	251	31,047	2021/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	180	181	22,405	2022/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	230	231	28,600	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	250	252	31,096	2020/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	220	222	27,457	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	70	72	8,909	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	340	351	43,293	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	230	239	29,559	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	240	257	31,733	2025/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	300	320	39,509	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	140	149	18,423	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	330	349	43,065	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	610	680	83,870	2031/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	30	30	3,794	2050/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	300	326	40,219	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	320	353	43,603	2024/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	190	214	26,475	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	110	115	14,295	2066/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	370	427	52,760	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	230	250	30,886	2022/10/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	480	539	66,511	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	230	238	29,428	2020/10/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	580	708	87,311	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.75	500	609	75,151	2027/10/25
		FRANCE (GOVT OF)	3.0	1,220	1,337	164,958	2022/4/25
		FRANCE (GOVT OF)	3.25	300	328	40,458	2021/10/25
		FRANCE (GOVT OF)	3.25	360	523	64,499	2045/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	3.5	260	323	39,944	2026/4/25
		FRANCE (GOVT OF)	3.75	930	1,009	124,406	2021/4/25
		FRANCE (GOVT OF)	4.0	370	571	70,401	2038/10/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	200	342	42,236	2055/4/25		
FRANCE (GOVT OF)	4.0	160	281	34,755	2060/4/25		
FRANCE (GOVT OF)	4.25	875	1,056	130,312	2023/10/25		
FRANCE (GOVT OF)	4.5	450	753	92,940	2041/4/25		
FRANCE (GOVT OF)	4.75	400	640	78,930	2035/4/25		
FRANCE (GOVT OF)	5.5	340	512	63,246	2029/4/25		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5.75	450	747	92,153	2032/10/25
		FRANCE (GOVT OF)	6.0	650	903	111,376	2025/10/25
		FRANCE (GOVT OF)	8.5	120	161	19,958	2023/4/25
		FRANCE (GOVT OF)	-	240	242	29,897	2023/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	580	605	74,633	2028/5/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVT	-	170	172	21,256	2024/1/15
		NETHERLANDS GOVT	0.25	120	123	15,268	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVT	0.5	500	524	64,640	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVT	0.75	120	127	15,683	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVT	0.75	140	148	18,287	2028/7/15
		NETHERLANDS GOVT	1.75	110	119	14,770	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVT	2.0	400	447	55,204	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVT	2.25	1,060	1,155	142,449	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVT	2.5	180	231	28,530	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVT	2.75	120	183	22,606	2047/1/15
		NETHERLANDS GOVT	3.25	140	151	18,724	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVT	3.5	110	115	14,219	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVT	3.75	40	46	5,719	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVT	3.75	130	217	26,854	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVT	4.0	160	256	31,579	2037/1/15
NETHERLANDS GOVT	5.5	100	148	18,302	2028/1/15		
NETHERLANDS GOVT	7.5	70	90	11,209	2023/1/15		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL	0.05	190	191	23,571	2021/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL	0.35	60	61	7,523	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	0.4	130	132	16,334	2022/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL	0.45	180	183	22,684	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	0.75	160	163	20,191	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	1.15	120	122	15,068	2020/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	1.3	210	221	27,314	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	1.4	200	210	25,964	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL	1.4	180	188	23,221	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	1.45	200	211	26,130	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	1.45	130	135	16,765	2029/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL	1.5	120	127	15,749	2027/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL	1.6	800	861	106,236	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL	1.95	250	275	33,944	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL	1.95	220	239	29,548	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	2.15	230	256	31,582	2025/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	2.35	160	178	22,048	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	2.7	90	101	12,453	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	2.75	630	719	88,647	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	2.9	240	281	34,684	2046/10/31

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユ ー ロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL	3.45	120	152	18,764	2066/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	3.8	500	592	73,012	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL	4.0	220	229	28,251	2020/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL	4.2	120	168	20,724	2037/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL	4.4	230	275	33,964	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	4.65	215	272	33,607	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	4.7	410	622	76,687	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	4.8	140	171	21,142	2024/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL	4.85	120	127	15,712	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	4.9	60	92	11,426	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	5.15	300	416	51,341	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	5.15	130	211	26,126	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL	5.4	290	350	43,187	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL	5.5	350	390	48,101	2021/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL	5.75	245	379	46,734	2032/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL	5.85	445	519	64,031	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL	5.9	330	455	56,219	2026/7/30
BONOS Y OBLIG DEL	6.0	400	591	72,933	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	0.2	90	91	11,302	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	80	82	10,217	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	130	136	16,889	2025/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	80	83	10,352	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	190	197	24,366	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	160	167	20,645	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	90	95	11,805	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	80	83	10,298	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.25	40	42	5,222	2033/4/22
		BELGIUM KINGDOM	1.45	40	42	5,216	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	100	103	12,813	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	50	52	6,435	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	50	56	6,978	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	40	45	5,549	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.25	110	122	15,041	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.25	110	127	15,753	2057/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	150	171	21,112	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	3.0	70	91	11,234	2034/6/22
		BELGIUM KINGDOM	3.75	150	158	19,595	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	100	153	18,879	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	90	101	12,541	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	60	84	10,423	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	870	966	119,168	2021/9/28
BELGIUM KINGDOM	4.25	150	173	21,393	2022/9/28		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユ ー ロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.25	145	229	28,240	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.5	70	91	11,307	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	5.0	330	530	65,345	2035/3/28
		BELGIUM KINGDOM	5.5	495	722	89,101	2028/3/28
オーストリア	国債証券	REP OF AUSTRIA	-	50	50	6,264	2022/9/20
		REP OF AUSTRIA	0.5	50	50	6,284	2029/2/20
		REP OF AUSTRIA	0.75	540	569	70,205	2026/10/20
		REP OF AUSTRIA	0.75	70	73	9,057	2028/2/20
		REP OF AUSTRIA	1.2	90	97	12,075	2025/10/20
		REP OF AUSTRIA	1.5	40	44	5,469	2047/2/20
		REP OF AUSTRIA	1.5	20	20	2,549	2086/11/2
		REP OF AUSTRIA	1.65	70	77	9,522	2024/10/21
		REP OF AUSTRIA	1.75	90	98	12,089	2023/10/20
		REP OF AUSTRIA	2.1	90	117	14,430	2117/9/20
		REP OF AUSTRIA	2.4	80	99	12,299	2034/5/23
		REP OF AUSTRIA	3.15	70	104	12,892	2044/6/20
		REP OF AUSTRIA	3.4	120	136	16,827	2022/11/22
		REP OF AUSTRIA	3.5	175	191	23,642	2021/9/15
		REP OF AUSTRIA	3.65	30	33	4,154	2022/4/20
		REP OF AUSTRIA	3.8	40	74	9,176	2062/1/26
		REP OF AUSTRIA	3.9	680	715	88,221	2020/7/15
		REP OF AUSTRIA	4.15	130	203	25,088	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	-	85	127	15,780	2027/7/15
		90	91	11,262	2023/7/15		
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVT	-	150	152	18,755	2022/4/15
		FINNISH GOVT	-	50	50	6,260	2023/9/15
		FINNISH GOVT	0.5	40	41	5,130	2026/4/15
		FINNISH GOVT	0.5	310	320	39,561	2027/9/15
		FINNISH GOVT	0.75	50	51	6,403	2031/4/15
		FINNISH GOVT	0.875	30	31	3,943	2025/9/15
		FINNISH GOVT	1.125	40	42	5,298	2034/4/15
		FINNISH GOVT	1.375	10	11	1,381	2047/4/15
		FINNISH GOVT	1.5	50	53	6,634	2023/4/15
		FINNISH GOVT	1.625	50	53	6,599	2022/9/15
		FINNISH GOVT	2.0	140	156	19,254	2024/4/15
		FINNISH GOVT	2.625	50	69	8,612	2042/7/4
		FINNISH GOVT	2.75	30	37	4,576	2028/7/4
		FINNISH GOVT	4.0	50	63	7,774	2025/7/4
アイルランド	国債証券	IRISH TSY	-	80	80	9,975	2022/10/18
		IRISH TSY	0.8	90	93	11,466	2022/3/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
アイルランド	国債証券	IRISH TSY	0.9	70	73	9,017	2028/5/15
		IRISH TSY	1.0	90	95	11,738	2026/5/15
		IRISH TSY	1.1	70	74	9,129	2029/5/15
		IRISH TSY	1.3	50	52	6,481	2033/5/15
		IRISH TSY	1.7	50	54	6,723	2037/5/15
		IRISH TSY	2.0	150	171	21,104	2045/2/18
		IRISH TSY	2.4	110	131	16,152	2030/5/15
		IRISH TSY	3.4	50	58	7,243	2024/3/18
		IRISH TSY	3.9	60	69	8,609	2023/3/20
		IRISH TSY	5.0	60	64	7,984	2020/10/18
		IRISH TSY	5.4	140	184	22,686	2025/3/13
小 計						8,687,648	
イギリス	国債証券	UK TSY	0.5	千英ポンド 240	千英ポンド 237	34,238	2022/7/22
		UK TSY	0.75	700	697	100,406	2023/7/22
		UK TSY	1.0	110	110	15,920	2024/4/22
		UK TSY	1.25	270	273	39,381	2027/7/22
		UK TSY	1.5	300	303	43,748	2021/1/22
		UK TSY	1.5	170	175	25,324	2026/7/22
		UK TSY	1.5	130	123	17,853	2047/7/22
		UK TSY	1.625	290	302	43,495	2028/10/22
		UK TSY	1.625	100	102	14,793	2071/10/22
		UK TSY	1.75	200	206	29,710	2022/9/7
		UK TSY	1.75	100	101	14,680	2037/9/7
		UK TSY	1.75	30	30	4,391	2049/1/22
		UK TSY	1.75	230	238	34,338	2057/7/22
		UK TSY	2.0	160	170	24,560	2025/9/7
		UK TSY	2.25	120	127	18,315	2023/9/7
		UK TSY	2.5	210	273	39,428	2065/7/22
		UK TSY	2.75	90	98	14,217	2024/9/7
		UK TSY	3.25	330	434	62,514	2044/1/22
		UK TSY	3.5	300	413	59,523	2045/1/22
		UK TSY	3.5	210	348	50,136	2068/7/22
		UK TSY	3.75	150	155	22,457	2020/9/7
		UK TSY	3.75	110	117	16,942	2021/9/7
		UK TSY	3.75	210	323	46,652	2052/7/22
		UK TSY	4.0	110	120	17,284	2022/3/7
		UK TSY	4.0	190	327	47,167	2060/1/22
		UK TSY	4.25	135	170	24,550	2027/12/7
UK TSY	4.25	170	228	32,943	2032/6/7		
UK TSY	4.25	180	252	36,398	2036/3/7		
UK TSY	4.25	130	189	27,264	2039/9/7		

銘柄			当 期 末				
			利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス	国債証券	UK TSY	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
		UK TSY	4.25	130	191	27,618	2040/12/7
		UK TSY	4.25	250	391	56,305	2046/12/7
		UK TSY	4.25	197	319	45,949	2049/12/7
		UK TSY	4.25	232	401	57,784	2055/12/7
		UK TSY	4.5	310	438	63,194	2034/9/7
		UK TSY	4.5	225	350	50,403	2042/12/7
		UK TSY	4.75	125	172	24,772	2030/12/7
		UK TSY	4.75	285	436	62,908	2038/12/7
		UK TSY	5.0	165	203	29,265	2025/3/7
		UK TSY	6.0	120	173	24,913	2028/12/7
UK TSY	8.0	470	540	77,872	2021/6/7		
小 計						1,479,629	
スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVT		千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
		SWEDISH GOVT	0.75	560	591	6,790	2028/5/12
		SWEDISH GOVT	0.75	420	441	5,063	2029/11/12
		SWEDISH GOVT	1.0	740	796	9,141	2026/11/12
		SWEDISH GOVT	1.5	1,400	1,518	17,434	2023/11/13
		SWEDISH GOVT	2.5	520	604	6,935	2025/5/12
		SWEDISH GOVT	3.5	890	999	11,469	2022/6/1
SWEDISH GOVT	3.5	680	1,024	11,759	2039/3/30		
小 計						68,594	
ノルウェー	国債証券	NORWEGIAN GOVT		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
		NORWEGIAN GOVT	1.5	840	836	10,528	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVT	1.75	290	293	3,699	2025/3/13
		NORWEGIAN GOVT	1.75	350	352	4,436	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVT	2.0	500	511	6,438	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVT	2.0	430	441	5,558	2028/4/26
NORWEGIAN GOVT	3.0	1,000	1,072	13,507	2024/3/14		
小 計						44,169	
デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK		千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	1,010	1,064	17,573	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	770	839	13,853	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	770	874	14,433	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	1,250	1,364	22,534	2021/11/15
KINGDOM OF DENMARK	4.5	1,520	2,746	45,339	2039/11/15		
小 計						113,734	
ポーランド	国債証券	POLAND GOVT		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
		POLAND GOVT	1.75	230	230	6,610	2021/7/25
		POLAND GOVT	2.25	960	964	27,728	2022/4/25
POLAND GOVT	2.5	180	181	5,224	2023/1/25		

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ポーランド	国債証券	POLAND GOVT	%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
		POLAND GOVT	2.5	430	431	12,407	2024/4/25
		POLAND GOVT	2.5	340	335	9,634	2026/7/25
		POLAND GOVT	2.5	750	735	21,123	2027/7/25
		POLAND GOVT	2.75	170	168	4,832	2028/4/25
		POLAND GOVT	3.25	250	259	7,443	2025/7/25
		POLAND GOVT	4.0	420	453	13,034	2023/10/25
		POLAND GOVT	5.75	200	218	6,291	2021/10/25
		POLAND GOVT	5.75	230	257	7,390	2022/9/23
		POLAND GOVT	5.75	100	124	3,589	2029/4/25
小 計						125,310	
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT	1.75	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
		AUSTRALIAN GOVT	1.75	240	241	18,649	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.0	300	305	23,598	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.25	190	196	15,146	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.25	580	604	46,682	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.5	100	107	8,276	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	560	596	46,127	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	210	227	17,548	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	240	260	20,116	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	140	153	11,832	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	60	66	5,103	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	40	43	3,330	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.0	170	190	14,730	2047/3/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	245	269	20,846	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	390	443	34,263	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	80	93	7,253	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.75	190	236	18,251	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.25	370	435	33,633	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.5	180	237	18,324	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.75	330	406	31,374	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	5.5	200	232	17,926	2023/4/21
AUSTRALIAN GOVT	5.75	270	293	22,684	2021/5/15		
AUSTRALIAN GOVT	5.75	240	273	21,096	2022/7/15		
小 計						456,797	
シンガポール	国債証券	SINGAPORE GOVT	1.25	千シンガポールドル	千シンガポールドル		
		SINGAPORE GOVT	1.25	20	19	1,590	2021/10/1
		SINGAPORE GOVT	1.75	40	39	3,208	2023/2/1
		SINGAPORE GOVT	2.0	50	49	4,043	2024/2/1
		SINGAPORE GOVT	2.125	30	30	2,428	2026/6/1
		SINGAPORE GOVT	2.25	60	60	4,879	2021/6/1
		SINGAPORE GOVT	2.25	30	28	2,342	2036/8/1
		SINGAPORE GOVT	2.625	30	31	2,511	2028/5/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
シンガポール	国債証券	SINGAPORE GOVT	%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
			2.75	200	206	16,664	2023/7/1
			2.75	80	81	6,609	2042/4/1
			2.75	50	50	4,121	2046/3/1
			2.875	10	10	852	2029/7/1
			2.875	30	31	2,555	2030/9/1
			3.0	40	41	3,392	2024/9/1
			3.125	60	62	5,030	2022/9/1
			3.375	100	111	8,998	2033/9/1
	3.5	200	219	17,742	2027/3/1		
小 計						86,970	
マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVT	3.844	千マレーシアリングギット	千マレーシアリングギット		
				1,200	1,155	30,674	2033/4/15
			3.955	1,200	1,211	32,153	2025/9/15
			4.181	150	153	4,071	2024/7/15
			4.498	600	625	16,617	2030/4/15
	4.762	440	463	12,294	2037/4/7		
小 計						95,812	
南アフリカ	国債証券	REP SOUTH AFRICA	10.5	千南アフリカランド	千南アフリカランド		
				3,040	3,350	25,599	2026/12/21
			6.25	3,530	2,550	19,482	2036/3/31
			6.5	720	505	3,865	2041/2/28
			7.0	1,290	1,077	8,235	2031/2/28
			8.0	3,270	3,005	22,964	2030/1/31
			8.25	700	639	4,884	2032/3/31
			8.5	1,090	976	7,459	2037/1/31
			8.75	1,410	1,267	9,685	2044/1/31
			8.75	1,660	1,494	11,417	2048/2/28
	8.875	560	524	4,009	2035/2/28		
	9.0	610	565	4,318	2040/1/31		
小 計						121,921	
合 計						22,546,902	

(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) 金額の単位未満は切捨て。

(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。

(注4) 国籍は、組入資産の通貨を基準としています。

投資信託財産の構成

2019年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	22,546,902	96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	723,575	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	23,270,477	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (23,051,820千円) の投資信託財産総額 (23,270,477千円) に対する比率は99.1%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、2019年5月8日における邦貨換算レートは、1米ドル=110.19円、1カナダドル=81.78円、1メキシコペソ=5.79円、1ユーロ=123.29円、1英ポンド=144.00円、1スウェーデンクローナ=11.48円、1ノルウェークローネ=12.59円、1デンマーククローネ=16.51円、1ポーランドズロチ=28.74円、1オーストラリアドル=77.27円、1シンガポールドル=80.89円、1マレーシアリンギット=26.55円、1南アフリカランド=7.64円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

2019年5月8日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	23,270,477,892円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	293,042,812
公 社 債(評価額)	22,546,902,805
未 収 入 金	195,158,040
未 収 利 息	146,966,878
前 払 費 用	40,260,643
差 入 委 託 証 拠 金	48,146,714
(B) 負 債	194,167,283
未 払 金	193,216,183
未 払 解 約 金	951,100
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	23,076,310,609
元 本	18,254,512,323
次 期 繰 越 損 益 金	4,821,798,286
(D) 受 益 権 総 口 数	18,254,512,323口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,641円

(注1) 当期末における1口当たり純資産額 1,2641円

(注2) 期首元本額 12,804,000,846円

期中追加設定元本額 20,582,426,286円

期中一部解約元本額 15,131,914,809円

(注3) 元本の内訳

MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ) 693,810,769円

MHAM外国債券インデックスファンド 70,516,829円

MHAM外国債券パッシブファンド【適格機関投資家限定】 3,516,288,066円

MHAM動的パッケージファンド【適格機関投資家限定】 12,870,608,306円

コア資産形成ファンド 63,318,242円

MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ) 974,835,555円

動的パッケージファンド<DC年金> 65,134,556円

損益の状況

(2018年5月9日から2019年5月8日まで)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	469,518,090円
受 取 利 息	469,357,475
そ の 他 収 益 金	268,584
支 払 利 息	△ 107,969
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	199,517,283
売 買 益	822,950,682
売 買 損	△ 623,433,399
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 2,921,126
取 引 益	862,127
取 引 損	△ 3,783,253
(D) 信 託 報 酬 等	△ 10,622,815
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)	655,491,432
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	3,128,840,231
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,974,066,714
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 3,936,600,091
(I) 計 (E + F + G + H)	4,821,798,286
次 期 繰 越 損 益 金(I)	4,821,798,286

(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) (D)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) (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4) (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。