

## 運用報告書 (全体版)

第5期<決算日2020年5月8日>

### 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)

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	2015年10月19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) に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) の動きに連動する投資成果を目指します。	
主要投資対象	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)	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	FTSE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。
運用方法	公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。	
組入制限	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)	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。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

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、「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)」は、2020年5月8日に第5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/>

# 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)

## ■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
(設定日) 2015年10月19日	円 10,000	円 -	% -	ポイント 10,000.00	% -	% -	% -	百万円 10
1期(2016年5月9日)	10,098	0	1.0	10,227.46	2.3	93.8	-	1,110
2期(2017年5月8日)	9,908	0	△1.9	10,081.89	△1.4	99.8	-	1,424
3期(2018年5月8日)	9,843	0	△0.7	10,068.60	△0.1	95.8	-	745
4期(2019年5月8日)	10,014	0	1.7	10,312.56	2.4	96.0	-	1,254
5期(2020年5月8日)	10,769	0	7.5	11,155.20	8.2	95.9	-	1,338

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(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。

(注4) ベンチマーク (FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)) は、基準価額への反映を考慮して前営業日の値を用いて、設定日 (2015年10月19日) を10,000として指数化しております。小数点第3位を四捨五入しています (以下同じ)。

(注5) FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) は、FTSE Fixed Income L L Cにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス (円ベースの指数) で、対円での為替ヘッジコストが考慮されています。FTSE Fixed Income L L C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 L L C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 L L Cに帰属します (以下同じ)。

(注6) △ (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		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・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) 2019年5月8日	円 10,014	% -	ポイント 10,312.56	% -	% 96.0	% -
5月末	10,120	1.1	10,422.83	1.1	96.7	-
6月末	10,280	2.7	10,587.69	2.7	98.1	-
7月末	10,322	3.1	10,635.40	3.1	96.8	-
8月末	10,639	6.2	10,965.78	6.3	98.3	-
9月末	10,563	5.5	10,885.15	5.6	96.7	-
10月末	10,430	4.2	10,750.69	4.2	97.3	-
11月末	10,424	4.1	10,744.40	4.2	96.8	-
12月末	10,359	3.4	10,678.32	3.5	98.2	-
2020年1月末	10,540	5.3	10,875.48	5.5	97.1	-
2月末	10,657	6.4	10,996.84	6.6	99.5	-
3月末	10,799	7.8	11,151.75	8.1	96.5	-
4月末	10,786	7.7	11,163.35	8.3	96.0	-
(期末) 2020年5月8日	10,769	7.5	11,155.20	8.2	95.9	-

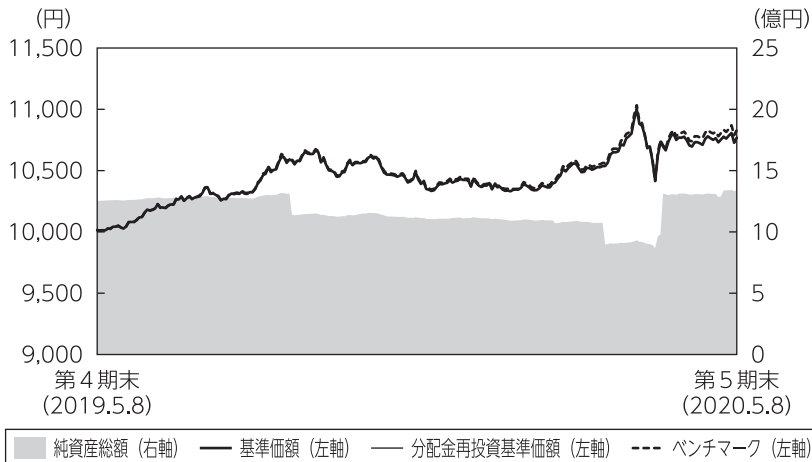
(注1) 騰落率は期首比です。

(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 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

### 基準価額等の推移



第5期首：10,014円  
第5期末：10,769円  
(既払分配金0円)  
騰落率：7.5%  
(分配金再投資ベース)

- (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 (F T S E世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・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

海外債券市場が上昇したことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

## 投資環境

### ●海外債券市況

海外債券市場は上昇しました。期首から8月にかけては米中貿易問題に対する不透明感などから上昇しました。その後は一進一退となりましたが、2月以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて経済への悪影響が懸念され、市場は大幅に上昇しました。3月には米国政府による大規模な景気刺激策や米連邦準備制度理事会（F R B）による緊急利下げなどを受けて一時急激に上下する場面もありましたが、期を通じては上昇しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券を高位に組み入れ、実質組入外貨建て資産に対して対円での為替ヘッジを行いました。

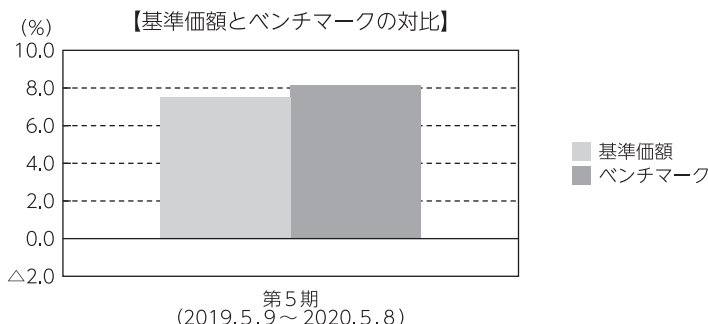
### ●MHAM外国債券インデックスマザーファンド

F T S E世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行いました。期を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。

なお、格下げによりベンチマーク除外となった南アフリカを全売却し、新規採用となったイスラエルを購入しました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドの基準価額騰落率はベンチマークを約0.6%下回りました。この差異は信託報酬や取引コストなどによるものです。



(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
	2019年5月9日 ～2020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	1,024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

MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券を高位に組み入れ、実質組入外貨建て資産に対して対円での為替ヘッジを行います。

### ●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、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行います。債券の組入比率は高位を目指します。

## ■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第 5 期		項目の概要
	(2019年5月9日 ～2020年5月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	35円	0.338%	(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10,460円です。 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)	(29)	(0.273)	
(販売会社)	( 1)	(0.011)	
(受託会社)	( 6)	(0.055)	
(b) その他費用	4	0.033	(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等
(保管費用)	( 2)	(0.020)	
(監査費用)	( 0)	(0.004)	
(その他)	( 1)	(0.010)	
合計	39	0.372	

(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。

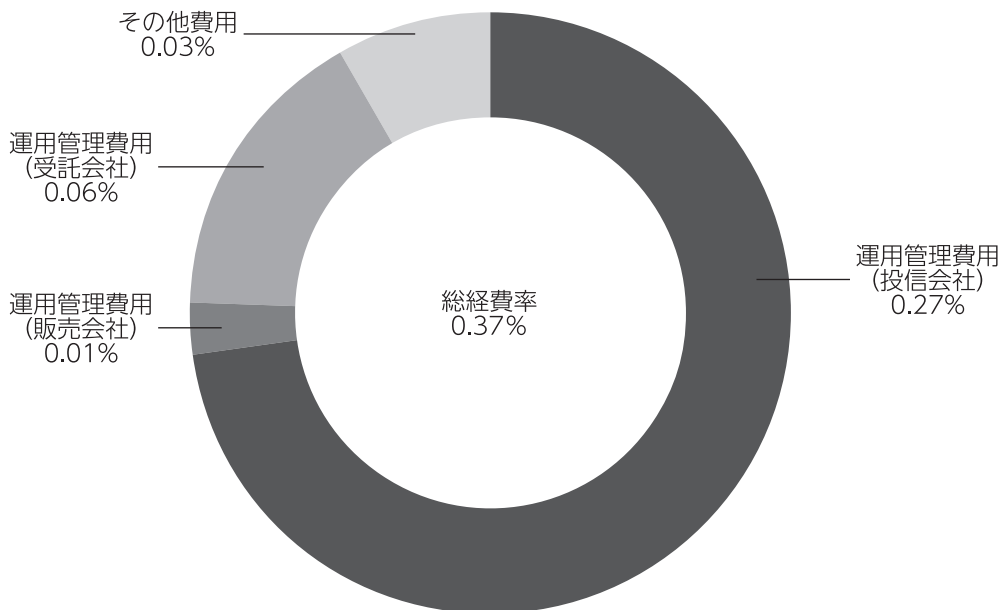
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.37%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2019年5月9日から2020年5月8日まで）

	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 597,228	千円 787,157	千口 564,683	千円 739,389

## ■利害関係人との取引状況等（2019年5月9日から2020年5月8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
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	千口 974,835	千口 1,007,380	千円 1,319,970

## ■投資信託財産の構成

2020年5月8日現在

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	千円 1,319,970	% 98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	22,034	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	1,342,005	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) 期末のMHAM外国債券インデックス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、15,431,634千円、99.7%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、2020年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.36円、1カナダ・ドル=76.31円、1オーストラリア・ドル=69.42円、1シンガポール・ドル=75.36円、1イギリス・ポンド=131.74円、1イスラエル・シェケル=30.31円、1デンマーク・クローネ=15.46円、1ノルウェー・クローネ=10.41円、1スウェーデン・クローナ=10.86円、1メキシコ・ペソ=4.45円、1マレーシア・リンギット=24.74円、1ポーランド・ズロチ=25.34円、1ユーロ=115.36円です。



## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,641,555,940円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	268,122
MHAM外国債券インデックス マザーファンド (評価額)	1,319,970,941
未 収 入 金	1,321,316,877
(B) 負 債	1,303,535,566
未 払 金	1,301,626,355
未 払 信 託 報 酬	1,888,614
そ の 他 未 払 費 用	20,597
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	1,338,020,374
元 本	1,242,457,318
次 期 繰 越 損 益 金	95,563,056
(D) 受 益 権 総 口 数	1,242,457,318口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	10,769円

(注) 期首における元本額は1,252,261,672円、当期中における追加設定元本額は549,898,654円、同解約元本額は559,703,008円です。

## ■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,915円
受 取 利 息	592
支 払 利 息	△2,507
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	65,273,406
売 買 益	191,531,794
売 買 損	△126,258,388
(C) 信 託 報 酬 等	△3,994,470
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	61,277,021
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	7,103,507
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	27,182,528
(配 当 等 相 当 額)	(57,816,633)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△30,634,105)
(G) 合 計 (D+E+F)	95,563,056
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	95,563,056
追 加 信 託 差 損 益 金	27,182,528
(配 当 等 相 当 額)	(58,966,816)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△31,784,288)
分 配 準 備 積 立 金	68,380,528

(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	26,040,592円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	18,752,079
(c) 収 益 調 整 金	58,966,816
(d) 分 配 準 備 積 立 金	23,587,857
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	127,347,344
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,024.96
(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、基準価額の水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

# MHAM外国債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書

第12期（決算日 2020年5月8日）

（計算期間 2019年5月9日～2020年5月8日）

MHAM外国債券インデックスマザーファンドの第12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	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。
主要投資対象	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。
主な組入制限	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		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) (ベンチマーク)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率	ポイント	期中 騰落率			
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
12期(2020年5月8日)	13,103	3.7	470.28	3.4	97.2	—	15,441

(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、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3) 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、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）。

(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

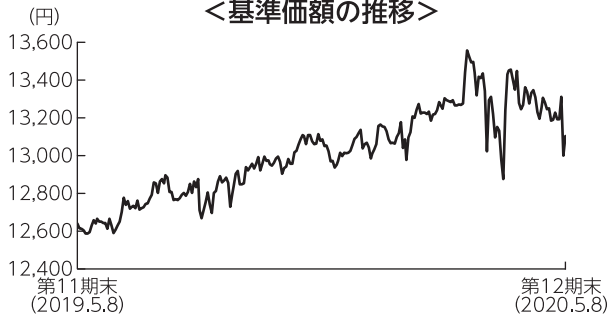
年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2019年 5 月 8 日	円 12,641	% -	ポイント 454.86	% -	% 97.7	% -
5 月末	12,630	△0.1	455.64	0.2	97.6	-
6 月末	12,793	1.2	459.55	1.0	97.9	-
7 月末	12,832	1.5	460.69	1.3	97.1	-
8 月末	12,920	2.2	464.28	2.1	97.9	-
9 月末	12,985	2.7	467.48	2.8	96.6	-
10 月末	13,113	3.7	470.06	3.3	97.3	-
11 月末	13,119	3.8	470.90	3.5	96.6	-
12 月末	13,178	4.2	472.81	3.9	97.8	-
2020年 1 月末	13,283	5.1	475.35	4.5	97.2	-
2 月末	13,440	6.3	484.79	6.6	100.0	-
3 月末	13,448	6.4	480.58	5.7	96.9	-
4 月末	13,192	4.4	472.88	4.0	96.8	-
(期 末) 2020年 5 月 8 日	13,103	3.7	470.28	3.4	97.2	-

(注1) 騰落率は期首比です。

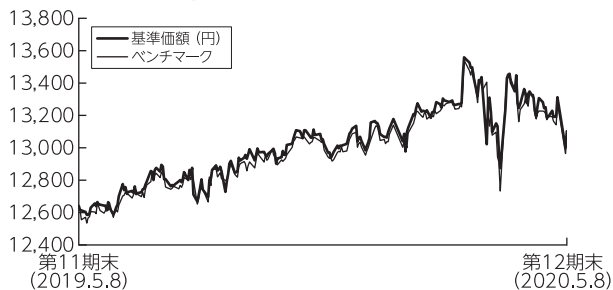
(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

＜基準価額の推移＞



＜基準価額とベンチマークの推移＞



(注) 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、期首の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は13,103円となり、前期末比で約3.7%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

海外債券市場が上昇したことなどを主因に、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

海外債券市場は上昇しました。期首から8月にかけては米中貿易問題に対する不透明感などから上昇しました。その後は一進一退となりましたが、2月以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて経済への悪影響が懸念され、市場は大幅に上昇しました。3月には米国政府による大規模な景気刺激策や米連邦準備制度理事会 (F R B) による緊急利下げなどを受けて一時急激に上下する場面もありましたが、期を通じては上昇しました。

為替市場 (対円) は大幅な円高になりました。

米ドルは、期首から8月頃にかけては米中貿易問題に対する不透明感などから下落しました。その後は良好な米経済指標や米中協議の進展期待などから値を戻しました。しかし2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や主要産油国による減産協議が決裂し原油価格が急落したことなどから、値動きの荒い中、再度下落しました。ユーロもおおむね同様の要因から下落しました。

## ポートフォリオについて

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して運用を行いました。期を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。

なお、格下げによりベンチマーク除外となった南アフリカを全売却し、新規採用となったイスラエルを購入しました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドの基準価額騰落率は為替レートの差異を考慮するとベンチマークを約0.1%下回りました。この差異は取引コストなどによるものです。

## 今後の運用方針

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して運用を行います。債券の組入比率は高位を目指します。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他費用 (保管費用)	4円	0.029%	(a) 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等
(その他)	(3)	(0.019)	
合計	(1)	(0.010)	
合計	4	0.029	
期中の平均基準価額は13,015円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ■ 売買及び取引の状況 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

### 公社債

			買付額	売付額
外         国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 81,569	千アメリカ・ドル 121,577 (-)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 4,634	千カナダ・ドル 6,460 (-)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 4,336	千オーストラリア・ドル 6,245 (-)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 585	千シンガポール・ドル 940 (-)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 7,585	千イギリス・ポンド 11,591 (-)
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 1,209	千イスラエル・シケル - (-)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 4,810	千デンマーク・クローネ 7,147 (-)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 2,305	千ノルウェー・クローネ 2,695 (-)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 2,154	千スウェーデン・クローナ 4,780 (-)

			買付額	売付額
外	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 21,285	千メキシコ・ペソ 32,109 (-)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 1,545	千マレーシア・リンギット 2,602 (-)
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 11,777	千南アフリカ・ランド 25,817 (-)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 3,169	千ポーランド・ズロチ 4,473 (-)
国	口	アイルランド	千ユーロ 1,132	千ユーロ 1,470 (-)
		オランダ	2,508	4,229 (-)
		ベルギー	3,825	5,675 (-)
		フランス	15,442	20,607 (-)
		ドイツ	8,387	11,250 (-)
		スペイン	6,512	10,092 (-)
		イタリア	10,943	14,810 (-)
		フィンランド	1,299	1,753 (-)
		オーストリア	2,513	3,847 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■利害関係人との取引状況等 (2019年5月9日から2020年5月8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	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	末		
		評 価 額				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 59,065	千アメリカ・ドル 66,557	千円 7,079,047	% 45.8	% -	% 20.7	% 17.5	% 7.7
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 3,240	千カナダ・ドル 3,733	千円 284,870	1.8	-	0.9	0.5	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 3,555	千オーストラリア・ドル 4,250	千円 295,060	1.9	-	1.4	0.5	-
シンガポール	千シンガポール・ドル 700	千シンガポール・ドル 810	千円 61,105	0.4	-	0.2	0.2	-
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 5,314	千イギリス・ポンド 7,611	千円 1,002,693	6.5	-	5.4	1.1	-
イ ス ラ エ ル	千イスラエル・シケル 940	千イスラエル・シケル 1,196	千円 36,269	0.2	-	0.2	-	-
デ ン マ ー ク	千デンマーク・クローネ 3,580	千デンマーク・クローネ 4,647	千円 71,856	0.5	-	0.4	0.1	-
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェー・クローネ 3,030	千ノルウェー・クローネ 3,327	千円 34,640	0.2	-	0.1	0.1	-
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデン・クローナ 2,940	千スウェーデン・クローナ 3,366	千円 36,563	0.2	-	0.2	0.0	-
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 21,636	千メキシコ・ペソ 23,549	千円 104,793	0.7	-	0.4	0.2	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシア・リンギット 2,570	千マレーシア・リンギット 2,837	千円 70,209	0.5	-	0.4	0.1	-
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 3,010	千ポーランド・ズロチ 3,246	千円 82,255	0.5	-	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	780	898	103,658	0.7	-	0.5	0.2	-
オ ラ ン ダ	2,120	2,607	300,772	1.9	-	1.2	0.5	0.2
ベルギー	2,680	3,302	380,937	2.5	-	1.9	0.4	0.1
フ ラ ン ス	10,885	13,182	1,520,727	9.8	-	6.6	2.3	1.0
ド イ ツ	7,770	9,557	1,102,507	7.1	-	4.7	1.9	0.6
ス ペ イ ン	6,170	7,352	848,134	5.5	-	3.8	1.5	0.2
イ タ リ ア	10,202	11,363	1,310,868	8.5	-	4.9	2.4	1.2
フィンランド	610	688	79,386	0.5	-	0.4	0.1	-
オーストリア	1,380	1,725	199,054	1.3	-	0.9	0.3	0.1
合 計	-	-	千円 15,005,413	97.2	-	55.5	30.0	11.6

(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						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評 価 額			
				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 1.5 01/31/22	国債証券	1.5000	210	214	22,860	2022/01/31	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	280	315	33,554	2026/01/31	
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	220	242	25,826	2025/01/31	
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	160	172	18,296	2024/01/31	
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	360	390	41,511	2024/01/31	
US T N/B 1.875 01/31/22	国債証券	1.8750	370	381	40,530	2022/01/31	
US T N/B 2.5 01/15/22	国債証券	2.5000	560	582	61,932	2022/01/15	
US T N/B 2.375 01/31/23	国債証券	2.3750	340	360	38,329	2023/01/31	
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	590	620	65,943	2025/01/31	
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	60	79	8,432	2026/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	180	246	26,244	2042/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	250	342	36,436	2043/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	380	478	50,868	2046/02/15	
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	110	157	16,775	2039/02/15	
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	120	168	17,894	2029/02/15	
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	160	239	25,463	2031/02/15	
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	100	154	16,439	2036/02/15	
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	160	267	28,471	2041/02/15	
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	240	355	37,836	2044/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	330	462	49,206	2049/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	250	258	27,465	2022/02/15	
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	50	78	8,345	2038/02/15	
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	90	147	15,690	2040/02/15	
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	610	652	69,416	2026/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	340	425	45,242	2045/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	190	262	27,966	2047/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	340	472	50,257	2048/02/15	
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	710	777	82,642	2024/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	740	799	85,064	2025/02/15	
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	620	728	77,452	2029/02/15	
US T N/B 1.75 02/28/22	国債証券	1.7500	200	205	21,890	2022/02/28	
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	300	350	37,312	2028/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	690	724	77,092	2023/02/15	
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	560	626	66,615	2027/02/15	
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	150	160	17,090	2024/02/29	
US T N/B 1.5 02/28/23	国債証券	1.5000	240	248	26,475	2023/02/28	
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	170	190	20,265	2026/02/28	
US T N/B 1.875 02/28/22	国債証券	1.8750	320	330	35,101	2022/02/28	
US T N/B 2.5 02/15/22	国債証券	2.5000	840	875	93,073	2022/02/15	
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	250	267	28,411	2023/02/28	
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	70	81	8,687	2050/02/15	
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	160	173	18,418	2030/02/15	

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	
(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 03/31/24	国債証券	2.1250	760	815	86,725	2024/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	440	456	48,589	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	240	267	28,398	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	280	310	32,982	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	330	352	37,446	2023/03/31
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	170	191	20,371	2025/04/30
US T N/B 1.75 04/30/22	国債証券	1.7500	180	185	19,755	2022/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	160	171	18,195	2024/04/30
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	320	333	35,487	2023/04/30
US T N/B 1.875 04/30/22	国債証券	1.8750	200	206	21,996	2022/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	300	334	35,604	2026/04/30
US T N/B 2.25 04/15/22	国債証券	2.2500	360	374	39,846	2022/04/15
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	230	247	26,318	2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	670	723	76,900	2024/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	49	75	8,078	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	100	159	16,984	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	20	32	3,417	2041/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	140	219	23,293	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	260	343	36,513	2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	190	272	28,948	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	250	340	36,220	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	330	456	48,600	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	160	201	21,442	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	160	227	24,210	2048/05/15
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	250	258	27,451	2022/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	470	645	68,696	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	60	95	10,166	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	390	408	43,424	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	650	708	75,345	2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	630	686	73,058	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	530	627	66,693	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	560	647	68,868	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	320	361	38,489	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	55	91	9,682	2037/05/15
US T N/B 1.875 05/31/22	国債証券	1.8750	100	103	11,014	2022/05/31
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	580	621	66,132	2026/05/15
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	230	239	25,525	2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	660	706	75,144	2024/05/31
US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	1.7500	290	299	31,858	2022/05/31
US T N/B 2.125 05/15/22	国債証券	2.1250	410	426	45,343	2022/05/15
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	530	571	60,765	2023/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	370	383	40,801	2023/06/30
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	90	96	10,258	2024/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	220	229	24,393	2022/06/30

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	250	280	29,874	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	30	32	3,470	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	230	247	26,324	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/22	国債証券	1.7500	260	268	28,602	2022/06/30
US T N/B 2.25 07/31/21	国債証券	2.2500	300	307	32,733	2021/07/31
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	180	194	20,641	2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	150	155	16,489	2023/07/31
US T N/B 2.0 07/31/22	国債証券	2.0000	250	260	27,684	2022/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	240	271	28,886	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	410	446	47,457	2026/07/31
US T N/B 1.125 07/31/21	国債証券	1.1250	140	141	15,069	2021/07/31
US T N/B 1.875 07/31/22	国債証券	1.8750	290	301	32,027	2022/07/31
US T N/B 2.625 07/15/21	国債証券	2.6250	230	236	25,182	2021/07/15
US T N/B 1.75 07/31/21	国債証券	1.7500	450	458	48,811	2021/07/31
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	110	163	17,404	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	120	180	19,207	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	250	323	34,411	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	250	345	36,721	2044/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	130	191	20,419	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	170	227	24,177	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	700	760	80,902	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	360	477	50,790	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	380	465	49,463	2049/08/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.1250	280	286	30,517	2021/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	300	322	34,288	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	140	152	16,225	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	320	385	41,004	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	460	641	68,281	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	690	776	82,607	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	640	681	72,526	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	600	712	75,781	2028/08/15
US T N/B 2.0 08/31/21	国債証券	2.0000	210	215	22,879	2021/08/31
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	150	154	16,476	2022/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	190	214	22,769	2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	170	176	18,773	2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	380	414	44,136	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	210	218	23,227	2022/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	120	128	13,640	2024/08/31
US T N/B 1.125 08/31/21	国債証券	1.1250	380	384	40,939	2021/08/31
US T N/B 1.625 08/31/22	国債証券	1.6250	790	816	86,873	2022/08/31
US T N/B 2.75 08/15/21	国債証券	2.7500	200	206	21,967	2021/08/15
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	420	432	46,040	2022/08/15
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	530	552	58,735	2024/08/31
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	250	256	27,327	2021/09/30

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	
(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 09/30/24	国債証券	2.1250	180	194	20,694	2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	230	239	25,420	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	210	217	23,183	2022/09/30
US T N/B 1.125 09/30/21	国債証券	1.1250	40	40	4,312	2021/09/30
US T N/B 1.875 09/30/22	国債証券	1.8750	720	749	79,720	2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	80	87	9,272	2023/09/30
US T N/B 2.75 09/15/21	国債証券	2.7500	910	942	100,201	2021/09/15
US T N/B 1.5 09/30/21	国債証券	1.5000	790	805	85,622	2021/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	90	96	10,285	2026/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	250	271	28,920	2024/10/31
US T N/B 2.0 10/31/21	国債証券	2.0000	210	215	22,942	2021/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	350	399	42,542	2025/10/31
US T N/B 1.25 10/31/21	国債証券	1.2500	300	304	32,431	2021/10/31
US T N/B 2.875 10/15/21	国債証券	2.8750	220	228	24,315	2021/10/15
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	300	314	33,461	2023/10/31
US T N/B 2.0 10/31/22	国債証券	2.0000	320	334	35,577	2022/10/31
US T N/B 1.5 10/31/21	国債証券	1.5000	200	204	21,699	2021/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	160	171	18,284	2026/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	35	39	4,169	2021/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	270	366	38,965	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	80	126	13,414	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	256	331	35,247	2042/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	180	271	28,826	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	110	146	15,541	2047/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	210	287	30,554	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	410	553	58,887	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	700	761	81,030	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	140	222	23,696	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	440	656	69,802	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	380	477	50,795	2049/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	360	370	39,381	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	260	286	30,485	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	660	800	85,109	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	730	756	80,478	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	740	805	85,685	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	690	758	80,646	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	530	554	59,004	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	500	564	60,001	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	260	277	29,509	2023/11/30
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	180	195	20,746	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	360	409	43,560	2025/11/30
US T N/B 1.875 11/30/21	国債証券	1.8750	250	256	27,313	2021/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	600	656	69,823	2023/11/30
US T N/B 1.75 11/30/21	国債証券	1.7500	160	163	17,441	2021/11/30

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 2.875 11/15/21	国債証券	2.8750	340	354	37,661	2021/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	510	563	59,934	2029/11/15
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	620	654	69,606	2024/11/30
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	280	300	31,970	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	470	511	54,351	2023/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	250	258	27,462	2021/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	20	21	2,237	2022/12/31
US T N/B 2.0 12/31/21	国債証券	2.0000	190	195	20,824	2021/12/31
US T N/B 2.625 12/15/21	国債証券	2.6250	600	623	66,356	2021/12/15
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	370	401	42,652	2026/12/31
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	290	309	32,928	2024/12/31
小 計	-	-	59,065	66,557	7,079,047	-
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	190	203	15,566	2024/03/01
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	110	110	8,433	2022/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	160	166	12,731	2023/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	70	72	5,569	2025/03/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	140	149	11,401	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	90	132	10,083	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	120	194	14,873	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	40	65	5,023	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	120	130	9,964	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	120	186	14,247	2041/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	110	115	8,827	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	100	103	7,924	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	60	67	5,136	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	110	120	9,190	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	250	259	19,825	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	120	138	10,593	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	50	53	4,080	2030/06/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	240	241	18,435	2021/09/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	150	157	12,017	2024/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	150	152	11,644	2022/09/01
CANADA 1.25 11/01/21	国債証券	1.2500	360	365	27,882	2021/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	150	230	17,577	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	90	125	9,591	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	100	123	9,448	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	40	62	4,797	2064/12/01
小 計	-	-	3,240	3,733	284,870	-
<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	100	127	8,817	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	215	244	17,006	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	330	422	29,320	2027/04/21

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>(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 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	170	186	12,928	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	370	450	31,292	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	350	403	28,041	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	240	289	20,095	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	180	254	17,648	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	170	229	15,917	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	280	322	22,360	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	30	35	2,488	2041/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	60	76	5,326	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	100	105	7,310	2031/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	240	268	18,661	2022/07/15
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	240	278	19,317	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	290	332	23,113	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	190	222	15,413	2029/11/21
小 計	—	—	3,555	4,250	295,060	—
<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 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	100	105	7,938	2024/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	80	94	7,123	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	60	78	5,950	2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	20	25	1,932	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	60	68	5,150	2028/05/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	30	32	2,454	2026/06/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	30	35	2,696	2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	100	106	8,056	2023/07/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	90	99	7,488	2024/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	30	35	2,676	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	100	127	9,637	2033/09/01
小 計	—	—	700	810	61,105	—
<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	150	238	31,463	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	180	301	39,688	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	70	160	21,182	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	60	79	10,409	2049/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	165	204	26,893	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	180	284	37,431	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	170	176	23,240	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	50	73	9,620	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	100	102	13,544	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	210	260	34,280	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	110	216	28,461	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	150	215	28,438	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	160	296	39,012	2065/07/22

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 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	140	329	43,349	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	170	185	24,415	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	120	129	17,111	2027/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	240	242	31,972	2022/07/22
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	140	236	31,095	2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	300	322	42,458	2023/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	160	177	23,323	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	110	172	22,726	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	250	301	39,686	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	330	343	45,236	2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	90	144	18,983	2071/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	250	281	37,063	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	220	233	30,824	2029/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	120	179	23,673	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	80	140	18,500	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	175	321	42,362	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	90	171	22,625	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	162	361	47,618	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	130	223	29,508	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	115	169	22,288	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	167	335	44,201	2049/12/07
小 計	—	—	5,314	7,611	1,002,693	—
<b>(イスラエル)</b>		%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	240	411	12,479	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	90	127	3,860	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	340	370	11,220	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	270	287	8,707	2025/08/31
小 計	—	—	940	1,196	36,269	—
<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	970	1,829	28,283	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	620	699	10,807	2025/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	330	354	5,480	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	780	835	12,922	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	510	551	8,521	2029/11/15
DENMARK 0.25 11/15/22	国債証券	0.2500	370	377	5,840	2022/11/15
小 計	—	—	3,580	4,647	71,856	—
<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	200	215	2,243	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	300	330	3,442	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	900	1,002	10,437	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	290	313	3,263	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	330	373	3,888	2028/04/26

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>		%	千ルウェー・クローネ	千ルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	700	742	7,730	2023/05/24
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	310	349	3,635	2029/09/06
小 計	—	—	3,030	3,327	34,640	—
<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 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	300	469	5,099	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	400	430	4,672	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	850	971	10,551	2025/05/12
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	600	639	6,943	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	420	455	4,943	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	370	400	4,351	2029/11/12
小 計	—	—	2,940	3,366	36,563	—
<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	2,289	2,310	10,281	2026/03/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	2,428	2,813	12,519	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	1,175	1,288	5,732	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	3,434	3,527	15,697	2022/06/09
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	2,350	2,608	11,608	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	1,544	1,626	7,240	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	1,257	1,359	6,050	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	900	1,021	4,546	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	911	1,184	5,271	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	915	1,007	4,482	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	1,052	1,248	5,557	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	1,071	1,167	5,195	2023/12/07
MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	国債証券	7.2500	2,310	2,384	10,610	2021/12/09
小 計	—	—	21,636	23,549	104,793	—
<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 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	310	365	9,054	2046/03/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	200	226	5,611	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	150	161	3,987	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	300	353	8,744	2037/04/07
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	220	245	6,073	2031/06/30
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	250	267	6,617	2024/07/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	400	429	10,633	2025/09/15
MALAYSIA 3.795 09/30/22	国債証券	3.7950	200	206	5,119	2022/09/30
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	310	333	8,243	2026/11/30
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	230	247	6,122	2027/11/16
小 計	—	—	2,570	2,837	70,209	—
<b>(ポーランド)</b>		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	480	504	12,777	2023/01/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	390	427	10,824	2028/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	170	175	4,453	2022/04/25



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>(ポーランド)</b>		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	280	298	7,570	2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	320	343	8,711	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	300	333	8,444	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	180	193	4,909	2027/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	230	257	6,532	2022/09/23
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.7500	200	215	5,455	2021/10/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	170	188	4,769	2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	290	308	7,806	2024/10/25
小 計	-	-	3,010	3,246	82,255	-
<b>(ユーロ…アイルランド)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	80	102	11,865	2045/02/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	60	68	7,913	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	70	89	10,279	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	90	101	11,652	2023/03/20
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	40	46	5,361	2050/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	110	134	15,466	2030/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	120	130	15,050	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	70	74	8,615	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	60	70	8,169	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	20	19	2,267	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	60	60	7,016	2027/05/15
小 計	-	-	780	898	103,658	-
<b>(ユーロ…オランダ)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.5000	70	85	9,871	2023/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	150	273	31,554	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	130	224	25,893	2047/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	100	145	16,813	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	100	168	19,445	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	130	175	20,193	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	40	44	5,097	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/22	国債証券	0.0000	300	303	34,993	2022/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	80	86	9,946	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	160	170	19,645	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	270	287	33,164	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	210	233	26,939	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	120	125	14,455	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	140	153	17,692	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	120	130	15,064	2027/07/15
小 計	-	-	2,120	2,607	300,772	-
<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	160	173	20,057	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	80	115	13,358	2028/03/28

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…ベルギー)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	110	188	21,749	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	70	89	10,368	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	60	87	10,052	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	180	301	34,802	2035/03/28
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	100	171	19,789	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	70	85	9,850	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	20	25	2,890	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	50	72	8,407	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	60	86	10,020	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	420	452	52,194	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	150	168	19,486	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	80	87	10,144	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	110	119	13,797	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	90	94	10,888	2028/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	160	173	20,028	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	70	96	11,105	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	110	136	15,754	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	130	137	15,883	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	130	138	16,033	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	40	46	5,358	2037/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	150	167	19,313	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	80	83	9,601	2024/10/22
小 計	—	—	2,680	3,302	380,937	—
<b>(ユーロ…フランス)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 02/25/22	国債証券	0.0000	610	616	71,083	2022/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	230	234	27,053	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	110	112	12,949	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	340	345	39,853	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	120	152	17,565	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	380	467	53,890	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	280	502	58,007	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	120	236	27,312	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	130	273	31,518	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	340	511	59,032	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	350	374	43,211	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	200	331	38,273	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	190	306	35,342	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	150	200	23,117	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	230	279	32,207	2050/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	90	122	14,181	2066/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	480	534	61,610	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	300	376	43,376	2030/05/25

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…フランス)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	380	407	47,062	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	490	568	65,617	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	350	366	42,279	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	130	136	15,793	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	180	204	23,627	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	340	357	41,196	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	300	326	37,619	2027/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	300	321	37,074	2023/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	330	376	43,425	2036/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	230	284	32,787	2039/06/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	465	543	62,661	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	160	216	24,951	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	120	146	16,938	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	200	327	37,768	2038/10/25
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3.2500	300	316	36,527	2021/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	350	593	68,523	2032/10/25
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	340	363	41,974	2022/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	370	407	47,025	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	40	43	4,967	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	290	299	34,603	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	330	354	40,930	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	240	240	27,783	2029/11/25
小 計	—	—	10,885	13,182	1,520,727	—
<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	70	88	10,164	2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	150	223	25,801	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	70	117	13,532	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	210	348	40,208	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	230	401	46,267	2037/01/04
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2.0000	170	177	20,511	2022/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	240	254	29,384	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	300	321	37,140	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	220	237	27,362	2029/02/15
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	210	223	25,793	2023/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	100	109	12,601	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	130	142	16,459	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	270	287	33,210	2027/02/15
BUNDESobl 04/08/22	国債証券	0.0000	100	101	11,704	2022/04/08
BUNDESobl 04/14/23	国債証券	0.0000	170	173	20,072	2023/04/14
BUNDESobl 04/05/24	国債証券	0.0000	250	257	29,749	2024/04/05
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	120	128	14,813	2023/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	70	106	12,312	2027/07/04

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 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	100	144	16,696	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	120	226	26,167	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	200	357	41,205	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	200	332	38,305	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	140	285	32,922	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.2500	140	146	16,876	2021/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	420	443	51,111	2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	230	403	46,526	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	190	324	37,435	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	150	208	24,096	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	420	459	53,024	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	270	293	33,892	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	340	355	41,046	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	400	430	49,614	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	300	327	37,808	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	150	161	18,649	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	270	284	32,866	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	50	51	5,935	2050/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	120	124	14,378	2021/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	130	136	15,802	2022/09/04
BUNDESUBL 10/08/21	国債証券	0.0000	210	212	24,463	2021/10/08
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	140	143	16,592	2023/10/13
小 計	—	—	7,770	9,557	1,102,507	—
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	180	260	30,032	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	140	164	19,003	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	210	305	35,202	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	290	333	38,461	2023/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	230	245	28,323	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	230	263	30,426	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	170	181	20,944	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	160	174	20,176	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	200	211	24,452	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	200	212	24,514	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	130	131	15,155	2022/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	80	106	12,329	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	130	210	24,279	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	120	192	22,219	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	90	137	15,866	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	215	263	30,442	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	280	310	35,824	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	245	381	43,961	2032/07/30

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 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	160	185	21,401	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	180	190	21,952	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	30	32	3,793	2035/07/30
SPAIN 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	160	161	18,673	2021/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	250	251	28,993	2024/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	180	200	23,166	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	220	299	34,602	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	130	226	26,153	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	70	90	10,420	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	200	250	28,937	2048/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	230	253	29,194	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	200	212	24,541	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	210	221	25,572	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	180	177	20,451	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	230	265	30,583	2023/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	240	243	28,076	2022/10/31
小 計	-	-	6,170	7,352	848,134	-
<b>(ユーロ…イタリア)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	150	209	24,166	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	270	329	38,002	2037/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	150	151	17,471	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	130	148	17,158	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	330	370	42,791	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	90	89	10,295	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	390	456	52,607	2025/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	155	166	19,258	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	180	209	24,205	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	320	308	35,547	2032/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	230	262	30,226	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	220	220	25,422	2023/03/15
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	160	161	18,671	2022/04/15
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	160	161	18,614	2022/04/01
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	240	228	26,372	2030/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	310	429	49,544	2031/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	240	245	28,342	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	130	130	15,047	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	110	110	12,730	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	190	190	22,033	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	220	227	26,254	2027/06/01
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	国債証券	0.4500	60	60	6,923	2021/06/01
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	210	216	24,992	2026/07/15
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	国債証券	1.0000	140	140	16,236	2022/07/15

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…イタリア)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	220	228	26,368	2021/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	150	199	23,069	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	170	234	27,059	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	190	212	24,517	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	180	184	21,295	2027/08/01
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	180	180	20,818	2022/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	160	169	19,581	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	170	231	26,748	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	170	188	21,688	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	210	258	29,763	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	200	276	31,873	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	130	123	14,252	2050/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.7500	330	348	40,159	2021/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	160	176	20,353	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	80	97	11,278	2049/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	170	188	21,703	2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	170	169	19,534	2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	160	162	18,735	2022/09/15
ITALY BTPS 2.3 10/15/21	国債証券	2.3000	320	327	37,816	2021/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	340	356	41,078	2023/10/01
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	80	101	11,732	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	60	80	9,317	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	300	399	46,132	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	290	374	43,149	2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	130	144	16,694	2022/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	110	110	12,786	2024/11/15
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	国債証券	0.3500	70	69	8,047	2021/11/01
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	130	133	15,433	2025/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	107	112	12,992	2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	140	151	17,425	2028/12/01
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国債証券	2.1500	140	143	16,538	2021/12/15
小 計	-	-	10,202	11,363	1,310,868	-
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	50	54	6,294	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	20	25	2,966	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	30	31	3,645	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	60	68	7,935	2034/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	50	61	7,116	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	30	37	4,308	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	50	76	8,800	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	80	84	9,780	2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	30	32	3,705	2025/09/15

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	
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	30	31	3,655	2027/09/15
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	180	183	21,175	2023/09/15
小 計	—	—	610	688	79,386	—
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	10	22	2,617	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	20	26	3,003	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	110	116	13,438	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	80	86	9,934	2028/02/20
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	100	166	19,250	2037/03/15
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	80	105	12,211	2034/05/23
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	80	134	15,543	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	85	124	14,406	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	90	91	10,565	2023/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	175	184	21,304	2021/09/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	70	133	15,429	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	100	109	12,653	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	130	139	16,069	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	90	98	11,309	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	90	97	11,225	2023/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	30	43	4,999	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	40	44	5,089	2022/11/22
小 計	—	—	1,380	1,725	199,054	—
合 計	—	—	—	—	15,005,413	—

## ■投資信託財産の構成

2020年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 15,005,413	% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	475,459	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	15,480,872	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) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、15,431,634千円、99.7%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、2020年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.36円、1カナダ・ドル=76.31円、1オーストラリア・ドル=69.42円、1シンガポール・ドル=75.36円、1イギリス・ポンド=131.74円、1イスラエル・シェケル=30.31円、1デンマーク・クローネ=15.46円、1ノルウェー・クローネ=10.41円、1スウェーデン・クローナ=10.86円、1メキシコ・ペソ=4.45円、1マレーシア・リングギット=24.74円、1ポーランド・ズロチ=25.34円、1ユーロ=115.36円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	15,480,872,390円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	323,199,132
公 社 債(評価額)	15,005,413,244
未 収 利 息	89,155,011
前 払 費 用	17,539,340
差 入 委 託 証 拠 金	45,565,663
(B) 負 債	38,939,514
未 払 金	38,609,014
未 払 解 約 金	330,500
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	15,441,932,876
元 本	11,785,412,583
次 期 繰 越 損 益 金	3,656,520,293
(D) 受 益 権 総 口 数	11,785,412,583口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,103円

(注1) 期首元本額 18,254,512,323円  
追加設定元本額 12,274,416,063円  
一部解約元本額 18,743,515,803円

(注2) 期末における元本の内訳  
動的パッケージファンド<DC年金> 39,087,251円  
コア資産形成ファンド 33,367,045円  
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ) 576,006,932円  
MHAM外国債券インデックスファンド<海軍ヘッジあり>(ファンドラップ) 1,007,380,708円  
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定] 6,849,775,170円  
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定] 3,279,795,477円  
期末元本合計 11,785,412,583円

## ■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	510,011,572円
受 取 利 息	509,903,840
そ の 他 収 益 金	185,535
支 払 利 息	△77,803
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	421,047,111
売 買 益	1,773,739,886
売 買 損	△1,352,692,775
(C) そ の 他 費 用	△5,421,271
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	925,637,412
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,821,798,286
(F) 解 約 差 損 益 金	△5,778,333,942
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,687,418,537
(H) 合 計(D+E+F+G)	3,656,520,293
次 期 繰 越 損 益 金(H)	3,656,520,293

(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。