

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	信託期間は2001年2月22日から無期限です。	
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	外国債券インデックスファンド	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外国債券インデックスファンド	外貨建資産への投資には制限を設けません。 株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限ることとし、取得時において実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	外国債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。	

# 外国債券 インデックスファンド

## 運用報告書(全体版)

第18期(決算日 2019年2月21日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

### お問い合わせ先

フリーダイヤル:0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

PCサイト <http://www.smtam.jp/>

スマートフォンサイト <http://s.smtam.jp/>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

**【本運用報告書の記載について】**

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
第14期(2015年2月23日)	21,850	20	14.0	466.355	14.7	97.9	0.6	7,818
第15期(2016年2月22日)	20,605	0	△5.7	443.765	△4.8	97.5	1.0	7,018
第16期(2017年2月21日)	19,867	0	△3.6	431.050	△2.9	98.3	0.4	6,103
第17期(2018年2月21日)	20,302	0	2.2	442.764	2.7	96.9	1.3	5,578
第18期(2019年2月21日)	20,484	0	0.9	452.126	2.1	96.9	1.4	5,438

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2018年 2月21日	20,302	—	442.764	—	96.9	1.3
2月末	20,204	△0.5	443.211	0.1	96.9	1.3
3月末	20,324	0.1	445.875	0.7	96.8	1.0
4月末	20,563	1.3	450.787	1.8	97.3	1.3
5月末	20,030	△1.3	439.032	△0.8	97.6	0.9
6月末	20,306	0.0	444.974	0.5	97.7	0.9
7月末	20,444	0.7	448.912	1.4	98.1	0.5
8月末	20,416	0.6	449.733	1.6	98.0	0.6
9月末	20,748	2.2	455.629	2.9	97.5	1.0
10月末	20,359	0.3	446.445	0.8	98.1	0.5
11月末	20,527	1.1	451.152	1.9	97.0	1.4
12月末	20,367	0.3	447.211	1.0	98.4	0.4
2019年 1月末	20,249	△0.3	447.557	1.1	96.0	2.0
(当期末)						
2019年 2月21日	20,484	0.9	452.126	2.1	96.9	1.4

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

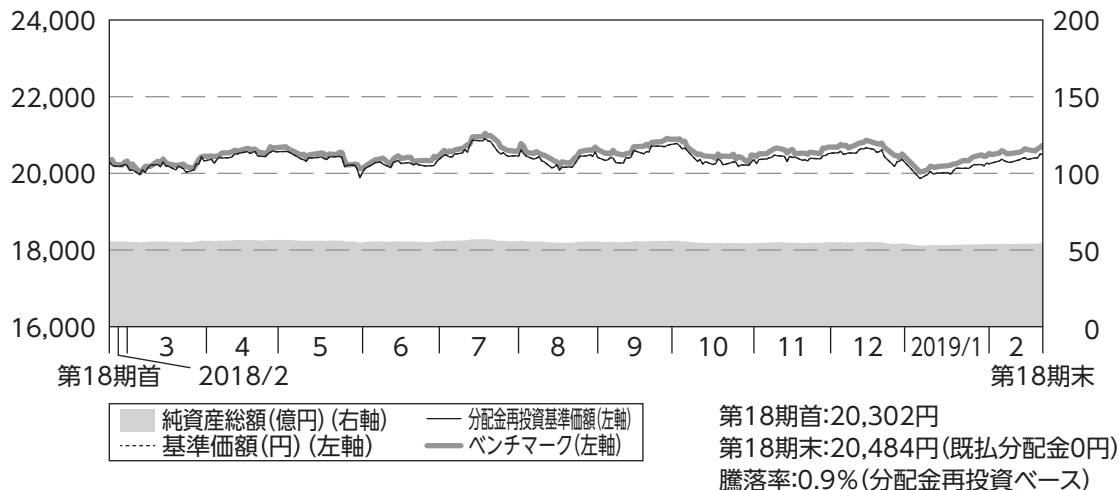
(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

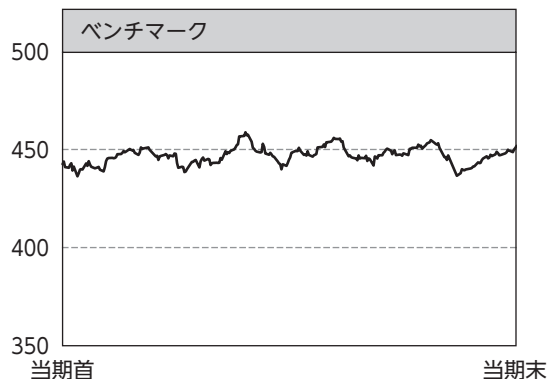


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2018年2月21日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

基準価額は、2018年3月上旬にかけて、米中貿易摩擦激化に対する警戒感の高まりや日米株式市場の急落を受けて、外国為替市場で主要通貨に対して円高が進んだことから、下落しました。3月中旬から7月中旬にかけては、米国の堅調な経済指標やFRB(米連邦準備理事会)の利上げ加速観測を背景に対米ドルで円安が進み、基準価額はもみ合いながらも上昇推移となりました。7月下旬から12月上旬にかけては、イタリア財政問題への懸念の高まりを受けて、対ユーロや対英ポンドで円高に推移したことから、基準価額はもみ合いながらも下落しました。12月中旬から2019年1月上旬にかけては、世界経済の減速懸念の高まりや世界的な株式市場の下落などを背景に、投資家のリスク回避姿勢が強まり、安全資産として債券が買われたものの、円高となったことから、基準価額は下落しました。その後期末にかけては、株式市場の回復や米中通商協議進展への期待の高まりを受けて円安推移となったことから、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



外国債券市場では、2018年10月上旬にかけて、FRBの利上げ継続観測から米国の長期金利は上昇基調で推移した一方で、イタリア財政問題などを背景にドイツや英国の長期金利はもみ合いながらも低下しました。10月中旬以降期末にかけては、世界的な株式市場の下落などを背景に、主要国の長期金利は低下しました。

外国為替市場では、2018年12月上旬にかけて、円は対米ドルでは米国の利上げ継続などを材料に円安推移となり、対ユーロや対英ポンドでは緩やかな円高推移となりました。その後は、世界的な株式市場の下落などを受けて、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、主要通貨に対して円高が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「外国債券マザーファンド」への投資を通じて、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### 【「外国債券マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

#### (1) 債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

#### (2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

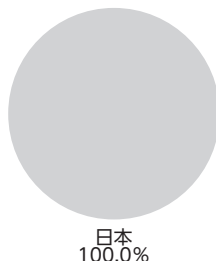
	当期末
	2019年2月21日
外国債券マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

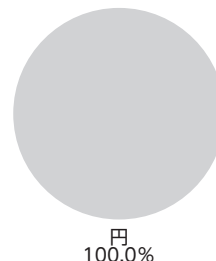
### ○資産別配分



### ○国別配分



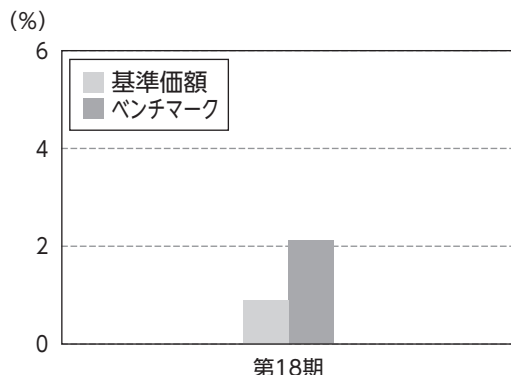
### ○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差<sup>(※)</sup>(マイナス要因)、信託報酬(マイナス要因)等です。

(※)当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

## 分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。  
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第18期	
	2018年2月22日～2019年2月21日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	14,465	

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)—印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2018年2月22日～2019年2月21日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	154円	0.756%	(a) 信託報酬 = $\frac{\text{[期中の平均基準価額]} \times \text{信託報酬率}}{\text{期中の平均基準価額}}$ は20,378円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(73)	(0.356)	
(販売会社)	(70)	(0.346)	
(受託会社)	(11)	(0.054)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}}$ 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
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	3	0.013	(d) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}}$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(2)	(0.012)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	157	0.770	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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



## 売買および取引の状況

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券マザーファンド	千口 37,275	千円 86,662	千口 136,142	千円 317,927

## 利害関係人※との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	158	158	100.0	158	158	100.0
コール・ローン	3,308	458	13.8	3,309	465	14.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <外国債券マザーファンド>

	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	41,791	41,791	100.0	41,971	41,971	100.0
為替直物取引	2,140	2,114	98.8	12,041	11,938	99.1
金 銭 信 託	21,471	21,471	100.0	21,471	21,471	100.0
コール・ローン	505,404	70,035	13.9	505,629	70,745	14.0

<平均保有割合 4.0%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

種 類	当 期 首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券マザーファンド	千口 2,408,052	千口 2,309,185	千円 5,435,360

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、56,992,555千口です。

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券マザーファンド	5,435,360	99.5
コール・ローン等、その他	27,881	0.5
投資信託財産総額	5,463,241	100.0

(注1) 外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(131,561,073千円)の投資信託財産総額(134,231,690千円)に対する比率は98.0%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=110.70円	1カナダドル=84.05円	1メキシコペソ=5.76円
1ユーロ=125.49円	1イギリスポンド=144.37円	1スウェーデンクローナ=11.88円
1ノルウェークローネ=12.88円	1デンマーククローネ=16.82円	1ポーランドズロチ=28.99円
1オーストラリアドル=79.64円	1シンガポールドル=81.92円	1マレーシアリンギット=27.21円
1南アフリカランド=7.90円		

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2019年2月21日現在
(A) 資 産	5,463,241,838円
コール・ローン等	24,636,311
外国債券マザーファンド(評価額)	5,435,360,827
未 収 入 金	3,244,700
(B) 負 債	25,158,563
未 払 解 約 金	4,313,268
未 払 信 託 報 酬	20,845,237
未 払 利 息	58
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,438,083,275
元 本	2,654,781,377
次 期 繰 越 損 益 金	2,783,301,898
(D) 受 益 権 総 口 数	2,654,781,377口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,484円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2018年2月22日 至 2019年2月21日
(A) 配 当 等 収 益	△11,433円
受 取 利 息	3
支 払 利 息	△11,436
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	89,186,526
売 買 損 益	95,135,063
売 買 損 益	△5,948,537
(C) 信 託 報 酬 等	△41,778,529
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	47,396,564
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	804,933,258
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,930,972,076
(配 当 等 相 当 額)	(2,316,360,994)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△385,388,918)
(G) 計 (D+E+F)	2,783,301,898
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	2,783,301,898
追 加 信 託 差 損 益 金	1,930,972,076
(配 当 等 相 当 額)	(2,316,715,770)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△385,743,694)
分 配 準 備 積 立 金	1,523,593,135
繰 越 損 益 金	△671,263,313

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は2,747,610,322円、期中追加設定元本額は116,841,682円、期中一部解約元本額は209,670,627円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	93,242,171円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	2,316,715,770円
(D) 分配準備積立金額	1,430,350,964円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	3,840,308,905円
(F) 期末残存口数	2,654,781,377口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	14,465円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

## お知らせ

---

当ファンドの約款に記載されている指数の名称を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2018年5月22日)

当ファンドの委託会社であります三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社は、2018年10月1日付で、三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継いたしました。

なお、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が本件承継前に三井住友信託銀行より受けていた投資助言(関連して三井住友信託銀行株式会社がその他の運用会社等から受けていた投資助言がある場合には同助言を含みます。)については、承継後の運用体制においても実質的に引き継がれております。

このため、本件承継に伴いファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。

# 外国債券マザーファンド

## 運用報告書

第18期（決算日 2019年2月7日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2001年2月22日から無期限です。
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

**【本運用報告書の記載について】**

- ・ 基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第14期(2015年2月9日)	24,380	16.2	469,338	16.7	96.8	1.6	253,174
第15期(2016年2月8日)	23,958	△1.7	459,396	△2.1	97.7	0.9	181,815
第16期(2017年2月7日)	22,198	△7.3	428,463	△6.7	97.6	0.9	162,596
第17期(2018年2月7日)	23,692	6.7	453,637	5.9	96.6	1.7	146,029
第18期(2019年2月7日)	23,318	△1.6	447,318	△1.4	96.6	1.6	133,456

(注)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2018年 2月 7日	23,692	—	453,637	—	96.6	1.7
2月末	23,045	△2.7	443,211	△2.3	97.0	1.3
3月末	23,196	△2.1	445,875	△1.7	96.8	1.0
4月末	23,483	△0.9	450,787	△0.6	97.4	1.3
5月末	22,890	△3.4	439,032	△3.2	97.7	0.9
6月末	23,219	△2.0	444,974	△1.9	97.8	0.9
7月末	23,392	△1.3	448,912	△1.0	98.1	0.5
8月末	23,375	△1.3	449,733	△0.9	98.1	0.6
9月末	23,769	0.3	455,629	0.4	97.5	1.0
10月末	23,339	△1.5	446,445	△1.6	98.2	0.5
11月末	23,547	△0.6	451,152	△0.5	97.0	1.4
12月末	23,377	△1.3	447,211	△1.4	98.5	0.4
2019年 1月末	23,258	△1.8	447,557	△1.3	96.0	2.0
(当期末) 2019年 2月 7日	23,318	△1.6	447,318	△1.4	96.6	1.6

(注1)騰落率は期首比です。

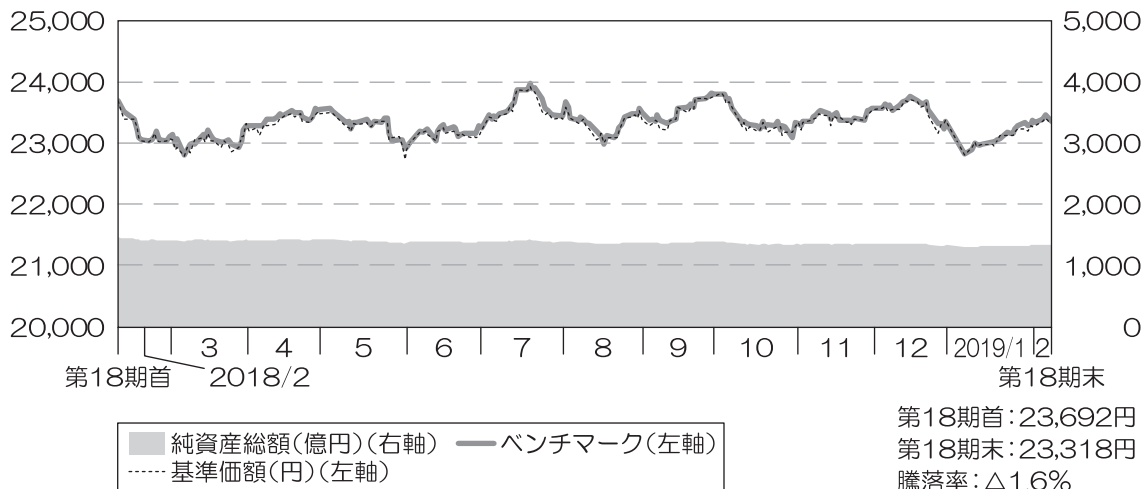
(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

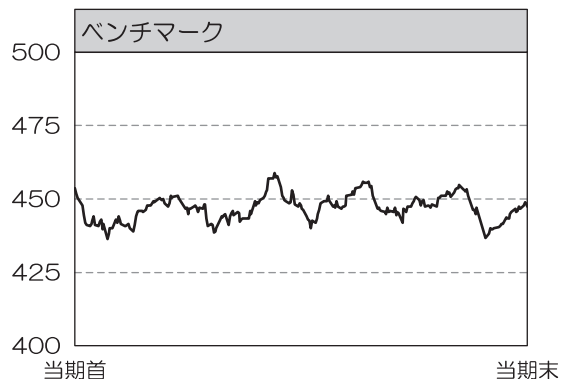


(注) ベンチマークは、2018年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

基準価額は、2018年3月上旬にかけて、米中貿易摩擦激化に対する警戒感の高まりや日米株式市場の急落を受けて、外国為替市場で主要通貨に対して円高が進んだことから、下落しました。3月中旬から7月中旬にかけては、米国の堅調な経済指標やFRB(米連邦準備理事会)の利上げ加速観測を背景に対米ドルで円安が進み、基準価額ともみ合いながらも上昇推移となりました。7月下旬から12月上旬にかけては、イタリア財政問題への懸念の高まりを受けて、対ユーロや対英ポンドで円高に推移したことから、基準価額ともみ合いながらも下落しました。12月中旬から2019年1月上旬にかけては、世界経済の減速懸念の高まりや世界的な株式市場の下落などを背景に、投資家のリスク回避姿勢が強まり、安全資産として債券が買われたものの、円高となったことから、基準価額は下落しました。その後期末にかけては、株式市場の回復や米中通商協議進展への期待の高まりを受けて円安推移となったことから、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



外国債券市場では、2018年10月上旬にかけて、FRBの利上げ継続観測から米国の長期金利は上昇基調で推移した一方で、イタリア財政問題などを背景にドイツや英国の長期金利はもみ合いながらも低下しました。10月中旬以降にかけては、世界的な株式市場の下落などを背景に、主要国の長期金利は低下しました。

外国為替市場では、2018年12月上旬にかけて、円は対米ドルでは米国の利上げ継続などを材料に円安推移となり、対ユーロや対英ポンドでは緩やかな円高推移となりました。その後は、世界的な株式市場の下落などを受けて、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、主要通貨に対して円高が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用し、先物を含む実質の債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

### (2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

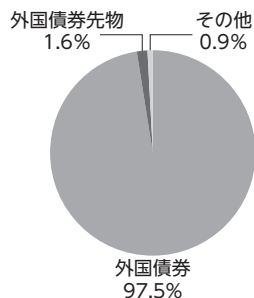
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	0.8%
2	T 1.25% 03/31/21	アメリカ	0.7%
3	T 1.375% 04/30/20	アメリカ	0.7%
4	T 2.875% 08/15/45	アメリカ	0.7%
5	T 2.25% 01/31/24	アメリカ	0.7%
6	T 1.625% 04/30/23	アメリカ	0.6%

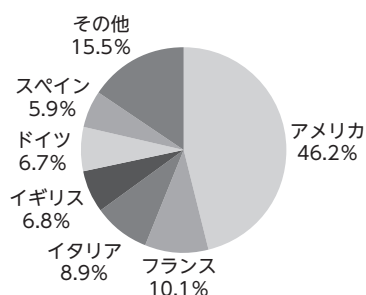
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	0.6%
8	T 3.125% 08/15/44	アメリカ	0.6%
9	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	0.6%
10	T 3.625% 02/15/21	アメリカ	0.6%
組入銘柄数		617	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

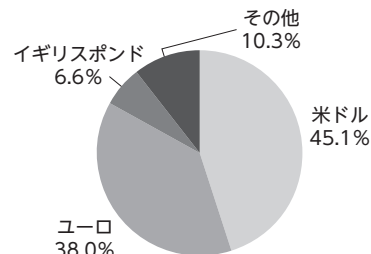
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



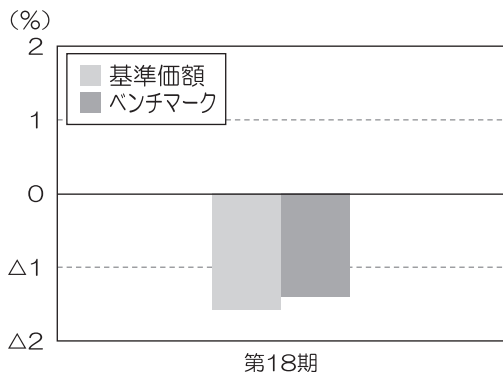
(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.6%買建てております。



## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



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

(※1) 当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

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

## 今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2018年2月8日～2019年2月7日)		
	金額	比率	
<b>(a) 売買委託手数料</b>	<b>0円</b>	<b>0.001%</b>	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
<b>(b) 有価証券取引税</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
<b>(c) その他費用</b>	<b>3</b>	<b>0.014</b>	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(3)	(0.013)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
<b>合計</b>	<b>3</b>	<b>0.015</b>	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(23,324円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

		当 期		
		買 付 額	売 付 額	
外	ア メ リ カ	国債証券	千米ドル 125,666	千米ドル 129,056
	カ ナ ダ	国債証券	千カナダドル 7,600	千カナダドル 11,461
	メ キ シ コ	国債証券	千メキシコペソ 17,300	千メキシコペソ 19,339
	ド イ ツ	国債証券	千ユーロ 11,882	千ユーロ 19,403
	イ タ リ ア	国債証券	18,021	25,731
	フ ラ ン ス	国債証券	13,714	19,636
	オ ラ ン ダ	国債証券	1,872	4,405
	ス ペ イ ン	国債証券	9,454	11,752
	ベ ル ギ ー	国債証券	2,539	4,463
	オ ー ス ト リ ア	国債証券	1,760	3,797
	フ ィ ン ラ ン ド	国債証券	573	716
	ア イ ル ラ ン ド	国債証券	1,082	1,655
国	イ ギ リ ス	国債証券	千イギリスポンド 7,147	千イギリスポンド 13,025
	ス イ ス	国債証券	千スイスフラン 21	千スイスフラン 2,220
	ス ウ ェ ー デ ン	国債証券	千スウェーデンクローナ 3,228	千スウェーデンクローナ 13,210
	ノ ル ウ ェ ー	国債証券	千ノルウェークローネ 1,921	千ノルウェークローネ 9,191
	デ ン マ ー ク	国債証券	千デンマーククローネ 4,288	千デンマーククローネ 10,908
	ポ ー ラ ン ド	国債証券	千ポーランドズロチ 3,380	千ポーランドズロチ 5,256
	オ ー ス ト ラ リ ア	国債証券	千オーストラリアドル 2,690	千オーストラリアドル 5,631
	シ ン ガ ポ ー ル	国債証券	千シンガポールドル 1,666	千シンガポールドル 2,018
	マ レ ー シ ア	国債証券	千マレーシアリンギット 2,489	千マレーシアリンギット 4,339
	南 ア フ リ カ	国債証券	千南アフリカランド 8,887	千南アフリカランド 6,920

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 16,869	百万円 17,027	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
為 替 先 物 取 引	百万円 42,142	百万円 42,142	100.0	百万円 42,615	百万円 42,615	100.0
為 替 直 物 取 引	2,140	2,114	98.8	12,041	11,938	99.1
金 銭 信 託	21,462	21,462	100.0	21,462	21,462	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	508,981	74,242	14.6	509,440	74,534	14.6

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

### 〈外国(外貨建)公社債〉 (A)債券種類別開示

区 分	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち80%以下 組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千米ドル 546,110	千米ドル 542,439	千円 59,635,832	44.7	—	18.9	17.5	8.3
カ ナ ダ	千カナダドル 29,710	千カナダドル 31,838	2,648,629	2.0	—	0.9	0.6	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 182,900	千メキシコペソ 178,735	1,027,729	0.8	—	0.4	0.2	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 58,740	千ユーロ 69,354	8,663,037	6.5	—	3.8	1.6	1.0
イ タ リ ア	85,600	91,831	11,470,697	8.6	—	5.0	2.8	0.8
フ ラ ン ス	88,110	103,817	12,967,793	9.7	—	6.3	2.5	0.9
オ ラ ン ダ	16,920	20,376	2,545,207	1.9	—	1.2	0.6	0.1
ス ペ イ ン	51,640	60,426	7,547,863	5.7	—	3.7	1.4	0.6
ベ ル ギ ー	21,280	25,362	3,168,068	2.4	—	1.8	0.5	0.1
オーストリア	12,600	14,969	1,869,816	1.4	—	0.9	0.4	0.1
フィンランド	5,900	6,484	809,992	0.6	—	0.3	0.2	0.1
アイルランド	7,280	8,101	1,011,991	0.8	—	0.5	0.1	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 49,630	千イギリスポンド 61,574	8,755,889	6.6	—	4.9	0.9	0.7
ス イ ス	千スイスフラン —	千スイスフラン —	—	—	—	—	—	—
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 34,890	千スウェーデンクローナ 39,251	468,666	0.4	—	0.2	0.1	0.1
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 22,760	千ノルウェークローネ 23,570	303,355	0.2	—	0.1	0.1	—
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 31,010	千デンマーククローネ 40,273	673,779	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 26,590	千ポーランドズロチ 27,691	804,981	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 31,670	千オーストラリアドル 34,613	2,702,947	2.0	—	1.3	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,080	千シンガポールドル 6,281	509,480	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 22,120	千マレーシアリンギット 22,252	596,359	0.4	—	0.3	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 104,990	千南アフリカランド 95,904	779,702	0.6	—	0.5	0.1	—
合 計	—	—	128,961,823	96.6	—	51.9	30.9	13.9

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千米ドル	千米ドル	外貨建金額	邦貨換算金額				千米ドル	千円	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円			%	千米ドル	千米ドル	千円			
T 1.125% 02/28/21	1.125	4,550	4,423	486,270	2021/2/28	T 1.875% 06/30/20	1.875	3,200	3,170	348,540	2020/6/30		
T 1.125% 03/31/20	1.125	2,000	1,968	216,374	2020/3/31	T 1.875% 08/31/22	1.875	2,600	2,545	279,807	2022/8/31		
T 1.125% 06/30/21	1.125	4,000	3,874	425,946	2021/6/30	T 1.875% 09/30/22	1.875	1,500	1,468	161,397	2022/9/30		
T 1.25% 01/31/20	1.25	4,000	3,949	434,242	2020/1/31	T 1.875% 10/31/22	1.875	2,000	1,955	215,028	2022/10/31		
T 1.25% 03/31/21	1.25	8,500	8,279	910,278	2021/3/31	T 1.875% 11/30/21	1.875	3,500	3,441	378,406	2021/11/30		
T 1.25% 07/31/23	1.25	3,950	3,741	411,293	2023/7/31	T 2% 02/15/22	2.0	3,100	3,055	335,964	2022/2/15		
T 1.25% 10/31/21	1.25	4,950	4,788	526,398	2021/10/31	T 2% 02/15/23	2.0	6,500	6,375	700,966	2023/2/15		
T 1.375% 01/31/21	1.375	1,600	1,564	171,983	2021/1/31	T 2% 02/15/25	2.0	6,050	5,859	644,244	2025/2/15		
T 1.375% 02/29/20	1.375	5,000	4,938	542,970	2020/2/29	T 2% 02/28/21	2.0	3,150	3,117	342,688	2021/2/28		
T 1.375% 03/31/20	1.375	4,500	4,439	488,117	2020/3/31	T 2% 05/31/21	2.0	5,500	5,436	597,704	2021/5/31		
T 1.375% 04/30/20	1.375	8,250	8,133	894,185	2020/4/30	T 2% 05/31/24	2.0	1,500	1,460	160,618	2024/5/31		
T 1.375% 04/30/21	1.375	3,000	2,926	321,709	2021/4/30	T 2% 06/30/24	2.0	1,000	973	107,006	2024/6/30		
T 1.375% 05/31/20	1.375	5,000	4,923	541,315	2020/5/31	T 2% 07/31/20	2.0	4,000	3,968	436,250	2020/7/31		
T 1.375% 08/31/20	1.375	1,750	1,718	188,934	2020/8/31	T 2% 07/31/22	2.0	6,000	5,901	648,854	2022/7/31		
T 1.375% 08/31/23	1.375	3,450	3,282	360,928	2023/8/31	T 2% 08/15/25	2.0	3,750	3,619	397,919	2025/8/15		
T 1.375% 09/30/20	1.375	2,950	2,894	318,184	2020/9/30	T 2% 08/31/21	2.0	4,200	4,147	455,932	2021/8/31		
T 1.375% 09/30/23	1.375	7,100	6,749	742,076	2023/9/30	T 2% 09/30/20	2.0	4,000	3,964	435,893	2020/9/30		
T 1.375% 10/31/20	1.375	6,000	5,880	646,533	2020/10/31	T 2% 10/31/21	2.0	4,200	4,145	455,705	2021/10/31		
T 1.5% 01/31/22	1.5	3,000	2,915	320,475	2022/1/31	T 2% 11/15/21	2.0	1,300	1,283	141,054	2021/11/15		
T 1.5% 02/28/23	1.5	4,200	4,038	444,015	2023/2/28	T 2% 11/15/26	2.0	2,700	2,581	283,800	2026/11/15		
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	3,842	422,469	2023/3/31	T 2% 11/30/20	2.0	2,800	2,773	304,883	2020/11/30		
T 1.5% 08/15/26	1.5	8,300	7,668	843,055	2026/8/15	T 2% 11/30/22	2.0	5,500	5,401	593,791	2022/11/30		
T 1.625% 02/15/26	1.625	5,750	5,391	592,722	2026/2/15	T 2% 12/31/21	2.0	3,380	3,335	366,667	2021/12/31		
T 1.625% 04/30/23	1.625	8,100	7,815	859,240	2023/4/30	T 2.125% 03/31/24	2.125	1,200	1,177	129,441	2024/3/31		
T 1.625% 05/15/26	1.625	5,400	5,050	555,248	2026/5/15	T 2.125% 05/15/25	2.125	7,250	7,061	776,331	2025/5/15		
T 1.625% 05/31/23	1.625	4,350	4,194	461,105	2023/5/31	T 2.125% 06/30/21	2.125	3,000	2,973	326,913	2021/6/30		
T 1.625% 07/31/20	1.625	1,200	1,183	130,158	2020/7/31	T 2.125% 06/30/22	2.125	1,100	1,087	119,509	2022/6/30		
T 1.625% 08/15/22	1.625	1,400	1,359	149,433	2022/8/15	T 2.125% 07/31/24	2.125	1,500	1,468	161,483	2024/7/31		
T 1.625% 08/31/22	1.625	500	485	53,346	2022/8/31	T 2.125% 08/15/21	2.125	2,900	2,873	315,869	2021/8/15		
T 1.625% 10/15/20	1.625	5,270	5,189	570,574	2020/10/15	T 2.125% 08/31/20	2.125	1,000	993	109,220	2020/8/31		
T 1.625% 11/15/22	1.625	4,000	3,875	426,041	2022/11/15	T 2.125% 09/30/21	2.125	2,000	1,980	217,779	2021/9/30		
T 1.625% 11/30/20	1.625	5,000	4,919	540,828	2020/11/30	T 2.125% 09/30/24	2.125	2,200	2,151	236,581	2024/9/30		
T 1.75% 01/31/23	1.75	2,650	2,575	283,106	2023/1/31	T 2.125% 11/30/23	2.125	2,700	2,653	291,729	2023/11/30		
T 1.75% 02/28/22	1.75	3,650	3,570	392,583	2022/2/28	T 2.125% 11/30/24	2.125	1,400	1,367	150,397	2024/11/30		
T 1.75% 03/31/22	1.75	2,500	2,444	268,733	2022/3/31	T 2.125% 12/31/22	2.125	6,800	6,706	737,294	2022/12/31		
T 1.75% 04/30/22	1.75	2,000	1,954	214,833	2022/4/30	T 2.25% 01/31/24	2.25	8,100	8,001	879,659	2024/1/31		
T 1.75% 05/15/22	1.75	4,600	4,493	493,961	2022/5/15	T 2.25% 02/15/27	2.25	3,900	3,790	416,773	2027/2/15		
T 1.75% 05/15/23	1.75	1,750	1,696	186,540	2023/5/15	T 2.25% 03/31/21	2.25	900	894	98,391	2021/3/31		
T 1.75% 06/30/22	1.75	2,500	2,440	268,314	2022/6/30	T 2.25% 04/30/21	2.25	4,700	4,672	513,697	2021/4/30		
T 1.75% 10/31/20	1.75	4,000	3,946	433,833	2020/10/31	T 2.25% 07/31/21	2.25	4,500	4,472	491,712	2021/7/31		
T 1.75% 12/31/20	1.75	3,000	2,957	325,151	2020/12/31	T 2.25% 08/15/27	2.25	6,330	6,133	674,362	2027/8/15		
T 1.875% 04/30/22	1.875	2,800	2,746	301,945	2022/4/30	T 2.25% 08/15/46	2.25	7,450	6,359	699,131	2046/8/15		
T 1.875% 05/31/22	1.875	2,350	2,304	253,302	2022/5/31	T 2.25% 10/31/24	2.25	2,500	2,460	270,524	2024/10/31		
						T 2.25% 11/15/24	2.25	5,000	4,919	540,810	2024/11/15		

当 期 末					当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		償還年月日		
		外貨建金額	邦貨換算金額				外貨建金額	邦貨換算金額			
	%	千米ドル	千米ドル	千円		%	千米ドル	千米ドル	千円		
T 2.25% 11/15/25	2.25	6,500	6,362	699,545	2025/11/15	T 3.625% 08/15/43	3.625	1,600	1,769	194,545	2043/8/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	6,800	6,578	723,197	2027/11/15	T 3.75% 08/15/41	3.75	1,100	1,239	136,263	2041/8/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	3,500	3,458	380,266	2023/12/31	T 3.75% 11/15/43	3.75	3,000	3,384	372,132	2043/11/15
T 2.25% 12/31/24	2.25	3,700	3,639	400,085	2024/12/31	T 3.875% 08/15/40	3.875	1,550	1,778	195,514	2040/8/15
T 2.375% 05/15/27	2.375	3,600	3,529	388,022	2027/5/15	T 4.25% 05/15/39	4.25	850	1,024	112,684	2039/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	6,700	6,644	730,481	2024/8/15	T 4.25% 11/15/40	4.25	900	1,086	119,497	2040/11/15
T 2.625% 12/31/20	2.375	4,300	4,287	471,334	2020/12/31	T 4.375% 02/15/38	4.375	700	856	94,178	2038/2/15
T 2.5% 01/31/25	2.5	4,000	3,987	438,377	2025/1/31	T 4.375% 05/15/40	4.375	1,600	1,963	215,825	2040/5/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	5,350	4,842	532,428	2045/2/15	T 4.375% 05/15/41	4.375	1,350	1,659	182,439	2041/5/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	7,500	6,765	743,797	2046/2/15	T 4.375% 11/15/39	4.375	1,050	1,286	141,478	2039/11/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	3,700	3,695	406,290	2024/5/15	T 4.5% 02/15/36	4.5	1,000	1,230	135,278	2036/2/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	3,450	3,450	379,293	2023/8/15	T 4.5% 08/15/39	4.5	1,250	1,556	171,160	2039/8/15
T 2.625% 03/31/25	2.625	2,500	2,508	275,744	2025/3/31	T 4.625% 02/15/40	4.625	1,500	1,900	208,929	2040/2/15
T 2.625% 08/15/20	2.625	2,400	2,402	264,139	2020/8/15	T 4.75% 02/15/41	4.75	350	451	49,639	2041/2/15
T 2.625% 11/15/20	2.625	2,350	2,352	258,674	2020/11/15	T 5.0% 05/15/37	5.0	650	852	93,679	2037/5/15
T 2.75% 02/15/24	2.75	7,250	7,331	806,069	2024/2/15	T 5.25% 02/15/29	5.25	500	610	67,160	2029/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	4,670	4,697	516,481	2028/2/15	T 5.25% 11/15/28	5.25	900	1,095	120,461	2028/11/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	2,100	2,009	220,897	2042/8/15	T 5.375% 02/15/31	5.375	750	951	104,577	2031/2/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,700	4,442	488,442	2047/8/15	T 5.5% 08/15/28	5.5	250	308	33,920	2028/8/15
T 2.75% 09/30/20	2.75	1,400	1,404	154,388	2020/9/30	T 6.0% 02/15/26	6.0	600	730	80,292	2026/2/15
T 2.75% 11/15/23	2.75	4,450	4,498	494,590	2023/11/15	T 6.125% 11/15/27	6.125	1,050	1,331	146,421	2027/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	2,740	2,618	287,895	2042/11/15	T 6.25% 05/15/30	6.25	720	964	106,037	2030/5/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	4,700	4,440	488,163	2047/11/15	T 6.25% 08/15/23	6.25	1,350	1,563	171,941	2023/8/15
T 2.875% 05/15/28	2.875	2,260	2,295	252,375	2028/5/15	T 6.5% 11/15/26	6.5	450	572	62,918	2026/11/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	1,250	1,219	134,113	2043/5/15	T 8.0% 11/15/21	8.0	2,600	2,979	327,540	2021/11/15
T 2.875% 08/15/28	2.875	4,200	4,265	468,951	2028/8/15	T 8.75% 08/15/20	8.75	6,340	6,922	761,010	2020/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	8,130	7,910	869,656	2045/8/15					59,635,832	
T 2.875% 10/15/21	2.875	4,250	4,290	471,739	2021/10/15	小 計					
T 3% 05/15/42	3.0	1,100	1,100	120,944	2042/5/15	(カナダ) 国債証券	千カナダドル	千カナダドル			
T 3% 05/15/45	3.0	200	199	21,920	2045/5/15	CAN 0.5% 03/01/22	0.5	850	816	67,947	2022/3/1
T 3% 05/15/47	3.0	3,400	3,381	371,734	2047/5/15	CAN 0.75% 03/01/21	0.75	1,980	1,937	161,213	2021/3/1
T 3% 09/30/25	3.0	7,000	7,177	789,120	2025/9/30	CAN 0.75% 09/01/20	0.75	1,750	1,721	143,252	2020/9/1
T 3% 10/31/25	3.0	5,950	6,101	670,780	2025/10/31	CAN 0.75% 09/01/21	0.75	1,500	1,460	121,504	2021/9/1
T 3% 11/15/44	3.0	2,050	2,044	224,732	2044/11/15	CAN 1% 06/01/27	1.0	1,060	986	82,090	2027/6/1
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,300	1,329	146,143	2042/2/15	CAN 1% 09/01/22	1.0	1,150	1,117	92,960	2022/9/1
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,100	2,141	235,423	2043/2/15	CAN 1.5% 03/01/20	1.5	2,620	2,611	217,252	2020/3/1
T 3.125% 05/15/21	3.125	6,250	6,333	696,328	2021/5/15	CAN 1.5% 06/01/23	1.5	2,440	2,406	200,180	2023/6/1
T 3.125% 08/15/44	3.125	7,200	7,340	806,975	2044/8/15	CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,450	1,411	117,448	2026/6/1
T 3.125% 11/15/41	3.125	870	889	97,830	2041/11/15	CAN 2% 06/01/28	2.0	350	352	29,308	2028/6/1
T 3.375% 06/15/44	3.375	1,500	1,594	175,342	2044/5/15	CAN 2.25% 06/01/25	2.25	970	992	82,532	2025/6/1
T 3.5% 02/15/39	3.5	1,100	1,201	132,101	2039/2/15	CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,530	1,580	131,493	2024/6/1
T 3.5% 05/15/20	3.5	300	303	33,360	2020/5/15	CAN 2.75% 06/01/22	2.75	1,100	1,132	94,230	2022/6/1
T 3.625% 02/15/20	3.625	9,800	9,904	1,088,859	2020/2/15	CAN 2.75% 12/01/48	2.75	870	979	81,509	2048/12/1
T 3.625% 02/15/21	3.625	7,050	7,202	791,889	2021/2/15	CAN 2.75% 12/01/64	2.75	350	412	34,280	2064/12/1
T 3.625% 02/15/44	3.625	5,850	6,475	711,863	2044/2/15	CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,400	1,445	120,245	2021/6/1

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千カナダドル	千カナダドル	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	千円		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	千円		
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	2,550	2,605	216,764	2020/6/1	DBR 2% 08/15/23	2.0	1,890	2,096	261,879	2023/8/15		
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,500	1,897	157,880	2045/12/1	DBR 2.25% 09/04/20	2.25	1,900	1,984	247,930	2020/9/4		
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,050	1,385	115,254	2041/6/1	DBR 2.25% 09/04/21	2.25	1,950	2,091	261,216	2021/9/4		
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,060	1,517	126,260	2037/6/1	DBR 2.5% 01/04/21	2.5	2,130	2,256	281,899	2021/1/4		
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,110	1,501	124,887	2029/6/1	DBR 2.5% 07/04/44	2.5	1,800	2,552	318,880	2044/7/4		
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	590	860	71,547	2033/6/1	DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,750	2,520	314,773	2046/8/15		
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	480	704	58,584	2027/6/1	DBR 3% 07/04/20	3.0	2,750	2,888	360,746	2020/7/4		
小 計				2,648,629		DBR 3.25% 07/04/21	3.25	1,700	1,856	231,868	2021/7/4		
(メキシコ) 国債証券		千メキシ コペソ	千メキシ コペソ			DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,050	1,647	205,778	2042/7/4		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	6,400	7,186	41,320	2036/11/20	DBR 4.0% 01/04/37	4.0	1,550	2,479	309,689	2037/1/4		
MBONO 10% 12/05/24	10.0	22,350	24,245	139,412	2024/12/5	DBR 4.25% 07/04/39	4.25	970	1,658	207,127	2039/7/4		
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	8,450	7,317	42,076	2026/3/5	DBR 4.75% 07/04/28	4.75	700	1,008	125,964	2028/7/4		
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	17,400	16,570	95,278	2022/6/9	DBR 4.75% 07/04/34	4.75	1,430	2,359	294,771	2034/7/4		
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	25,200	24,310	139,782	2021/6/10	DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,050	1,932	241,435	2040/7/4		
MBONO 7.25% 12/09/21	7.25	2,300	2,248	12,926	2021/12/9	DBR 5.5% 01/04/31	5.5	1,160	1,882	235,081	2031/1/4		
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	13,350	12,689	72,966	2027/6/3	DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,500	2,253	281,430	2028/1/4		
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	11,850	11,162	64,183	2031/5/29	DBR 6.25% 01/04/24	6.25	720	954	119,278	2024/1/4		
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	15,500	14,018	80,606	2042/11/13	DBR 6.25% 01/04/30	6.25	610	1,012	126,525	2030/1/4		
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	7,650	7,090	40,772	2034/11/23	DBR 6.5% 07/04/27	6.5	200	310	38,779	2027/7/4		
MBONO 8% 06/11/20	8.0	22,400	22,344	128,481	2020/6/11	OBL 0% 04/08/22	-	1,030	1,046	130,726	2022/4/8		
MBONO 8% 11/07/47	8.0	4,650	4,302	24,740	2047/11/7	OBL 0% 04/14/23	-	600	610	76,236	2023/4/14		
MBONO 8% 12/07/23	8.0	9,200	9,144	52,580	2023/12/7	OBL 0% 04/17/20	-	2,050	2,063	257,783	2020/4/17		
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	8,000	8,046	46,266	2029/5/31	OBL 0.25% 10/16/20	0.25	1,800	1,825	228,005	2020/10/16		
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	8,200	8,058	46,334	2038/11/18	(イタリヤ) 国債証券							
小 計				1,027,729		BTIPS 0.05% 04/15/21	0.05	1,720	1,692	211,445	2021/4/15		
(ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ			BTIPS 0.2% 10/15/20	0.2	900	896	111,937	2020/10/15		
DBR 0% 08/15/26	-	2,050	2,065	258,041	2026/8/15	BTIPS 0.35% 06/15/20	0.35	900	900	112,440	2020/6/15		
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	2,930	3,002	374,982	2027/2/15	BTIPS 0.35% 11/01/21	0.35	800	786	98,192	2021/11/1		
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	300	302	37,805	2029/2/15	BTIPS 0.65% 10/15/23	0.65	560	534	66,786	2023/10/15		
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	260	263	32,924	2028/8/15	BTIPS 0.65% 11/01/20	0.65	1,200	1,202	150,202	2020/11/1		
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	700	731	91,373	2025/2/15	BTIPS 0.95% 03/01/23	0.95	1,800	1,756	219,372	2023/3/1		
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	3,137	391,948	2026/2/15	BTIPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,600	1,474	184,201	2026/12/1		
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	1,270	1,321	165,081	2028/2/15	BTIPS 1.35% 04/15/22	1.35	2,400	2,405	300,510	2022/4/15		
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	900	939	117,291	2027/8/15	BTIPS 1.45% 05/15/25	1.45	1,070	1,024	127,919	2025/5/15		
DBR 1% 08/15/24	1.0	1,950	2,089	261,026	2024/8/15	BTIPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,550	1,552	193,890	2022/9/15		
DBR 1% 08/15/25	1.0	1,500	1,618	202,172	2025/8/15	BTIPS 1.45% 11/15/24	1.45	600	579	72,431	2024/11/15		
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	910	1,026	128,180	2048/8/15	BTIPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,500	1,440	179,907	2025/6/1		
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	1,950	2,103	262,765	2023/2/15	BTIPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,350	1,284	160,494	2026/6/1		
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	1,360	1,472	183,924	2023/5/15	BTIPS 1.65% 03/01/32	1.65	450	383	47,964	2032/3/1		
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	1,450	1,589	198,591	2024/5/15	BTIPS 2% 12/01/25	2.0	1,050	1,033	129,064	2025/12/1		
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	2,050	2,196	274,354	2022/9/4	BTIPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,350	2,255	281,695	2027/8/1		
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,250	1,382	172,672	2024/2/15	BTIPS 2.15% 12/15/21	2.15	1,700	1,749	218,518	2021/12/15		
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	1,650	1,776	221,953	2022/7/4	BTIPS 2.2% 06/01/27	2.2	1,680	1,634	204,176	2027/6/1		
DBR 2% 01/04/22	2.0	970	1,041	130,136	2022/1/4	BTIPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,170	1,011	126,365	2036/9/1		



当期					期末								
銘柄	利率	額面金額		評価額		償還年月日	銘柄	利率	額面金額		評価額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額	
BTFS 2.45% 09/01/33	2.45	500	457	57,206	2033/9/1	FRTR 0.25% 11/25/20	0.25	1,350	1,367	170,872	2020/11/25		
BTFS 2.5% 12/01/24	2.5	1,800	1,842	230,138	2024/12/1	FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	2,050	2,042	255,179	2026/11/25		
BTFS 2.7% 03/01/47	2.7	1,700	1,446	180,647	2047/3/1	FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	3,100	3,181	397,445	2025/5/25		
BTFS 2.8% 03/01/67	2.8	520	425	53,131	2067/3/1	FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	2,250	2,295	286,735	2026/5/25		
BTFS 2.8% 12/01/28	2.8	1,100	1,098	137,249	2028/12/1	FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	3,280	3,352	418,792	2028/5/25		
BTFS 2.95% 09/01/38	2.95	550	508	63,551	2038/9/1	FRTR 1% 05/25/27	1.0	2,900	3,049	380,879	2027/5/25		
BTFS 3.25% 09/01/46	3.25	450	422	52,808	2046/9/1	FRTR 1% 11/25/25	1.0	2,240	2,369	296,036	2025/11/25		
BTFS 3.35% 03/01/35	3.35	650	650	81,288	2035/3/1	FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	350	361	45,199	2034/5/25		
BTFS 3.45% 03/01/48	3.45	810	773	96,605	2048/3/1	FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	1,750	1,780	222,428	2036/5/25		
BTFS 3.5% 03/01/30	3.5	1,850	1,939	242,227	2030/3/1	FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	3,200	3,459	432,130	2031/5/25		
BTFS 3.75% 03/01/21	3.75	1,550	1,645	205,599	2021/3/1	FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	2,600	2,820	352,283	2023/5/25		
BTFS 3.75% 05/01/21	3.75	1,550	1,649	205,978	2021/5/1	FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	540	539	67,449	2066/5/25		
BTFS 3.75% 08/01/21	3.75	1,900	2,027	253,275	2021/8/1	FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	970	1,056	131,960	2039/6/25		
BTFS 3.75% 09/01/24	3.75	3,570	3,886	485,435	2024/9/1	FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	3,000	3,303	412,699	2024/11/25		
BTFS 4% 02/01/37	4.0	2,000	2,159	269,739	2037/2/1	FRTR 2% 05/25/48	2.0	750	832	103,955	2048/5/25		
BTFS 4% 09/01/20	4.0	1,470	1,550	193,697	2020/9/1	FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	2,390	2,684	335,341	2024/5/25		
BTFS 4.25% 03/01/20	4.25	2,750	2,866	358,008	2020/3/1	FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	2,470	2,703	337,697	2022/10/25		
BTFS 4.5% 02/01/20	4.5	880	917	114,571	2020/2/1	FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	2,150	2,568	320,809	2030/5/25		
BTFS 4.5% 03/01/24	4.5	1,460	1,640	204,900	2024/3/1	FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	3,450	3,627	453,165	2020/10/25		
BTFS 4.5% 03/01/26	4.5	2,250	2,564	320,387	2026/3/1	FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	2,400	2,887	360,655	2027/10/25		
BTFS 4.5% 05/01/23	4.5	1,050	1,172	146,474	2023/5/1	FRTR 3% 04/25/22	3.0	3,750	4,156	519,160	2022/4/25		
BTFS 4.75% 08/01/23	4.75	1,610	1,823	227,769	2023/8/1	FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	2,710	3,793	473,825	2045/5/25		
BTFS 4.75% 09/01/21	4.75	2,630	2,875	359,148	2021/9/1	FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	4,120	4,532	566,115	2021/10/25		
BTFS 4.75% 09/01/28	4.75	1,650	1,925	240,570	2028/9/1	FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	1,950	2,045	255,469	2020/4/25		
BTFS 4.75% 09/01/44	4.75	1,500	1,755	219,226	2044/9/1	FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	3,120	3,865	482,875	2026/4/25		
BTFS 5% 03/01/22	5.0	1,450	1,612	201,357	2022/3/1	FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	3,700	4,045	505,282	2021/4/25		
BTFS 5% 03/01/25	5.0	1,300	1,508	188,398	2025/3/1	FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,090	1,795	224,293	2055/4/25		
BTFS 5% 08/01/34	5.0	1,800	2,166	270,567	2034/8/1	FRTR 4% 04/25/60	4.0	920	1,554	194,215	2060/4/25		
BTFS 5% 09/01/40	5.0	1,600	1,917	239,525	2040/9/1	FRTR 4% 10/25/38	4.0	1,800	2,696	336,830	2038/10/25		
BTFS 5.0% 08/01/39	5.0	1,440	1,733	216,504	2039/8/1	FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	4,000	4,837	604,239	2023/10/25		
BTFS 5.25% 11/01/29	5.25	2,300	2,787	348,130	2029/11/1	FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	2,450	3,978	496,930	2041/4/25		
BTFS 5.5% 09/01/22	5.5	1,700	1,939	242,321	2022/9/1	FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	2,250	3,516	439,188	2035/4/25		
BTFS 5.5% 11/01/22	5.5	2,200	2,515	314,267	2022/11/1	FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	2,500	3,726	465,509	2029/4/25		
BTFS 5.75% 02/01/33	5.75	2,010	2,571	321,176	2033/2/1	FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	2,220	3,628	453,281	2032/10/25		
BTFS 6% 05/01/31	6.0	2,300	2,975	371,709	2031/5/1	FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,450	2,021	252,525	2025/10/25		
BTFS 6.5% 11/01/27	6.5	1,250	1,621	202,481	2027/11/1	FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,100	1,507	188,241	2023/4/25		
BTFS 7.25% 11/01/26	7.25	350	467	58,432	2026/11/1	(オランダ) 国債証券							
BTFS 9% 11/01/23	9.0	1,800	2,391	298,665	2023/11/1	NETHER 0% 01/15/22	-	1,100	1,115	139,329	2022/1/15		
(フランス) 国債証券						NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	630	642	80,297	2025/7/15		
FRTR 0% 02/25/20	-	890	894	111,760	2020/2/25	NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,450	1,499	187,321	2026/7/15		
FRTR 0% 03/25/23	-	900	907	113,379	2023/3/25	NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	900	944	117,933	2027/7/15		
FRTR 0% 03/25/24	-	950	952	119,035	2024/3/25	NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	600	626	78,309	2028/7/15		
FRTR 0% 05/25/20	-	2,050	2,063	257,763	2020/5/25	NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,620	1,769	220,988	2023/7/15		
FRTR 0% 05/25/21	-	1,000	1,009	126,149	2021/5/25	NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,560	1,746	218,097	2024/7/15		

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額	
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	1,120	1,224	152,944	2022/7/15	SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	1,450	2,172	271,380	2032/7/30		
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	910	1,149	143,523	2033/1/15	SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	1,800	2,116	264,409	2022/1/31		
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	970	1,436	179,410	2047/1/15	SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,850	2,518	314,598	2026/7/30		
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	1,300	1,420	177,481	2021/7/15	SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	2,350	3,387	423,146	2029/1/31		
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	710	751	93,890	2020/7/15	<b>(ベルギー)</b>							
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	300	349	43,651	2023/1/15	<b>国債証券</b>							
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,080	1,770	221,111	2042/1/15	BGB 0.2% 10/22/23	0.2	180	182	22,813	2023/10/22		
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,120	1,757	219,542	2037/1/15	BGB 0.5% 10/22/24	0.5	350	358	44,789	2024/10/22		
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	850	1,253	156,606	2028/1/15	BGB 0.8% 06/22/25	0.8	1,100	1,144	142,957	2025/6/22		
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	700	918	114,768	2023/1/15	BGB 0.8% 06/22/27	0.8	750	770	96,269	2027/6/22		
<b>(スペイン)</b>						BGB 0.8% 06/22/28	0.8	840	855	106,878	2028/6/22		
<b>国債証券</b>						BGB 0.9% 06/22/29	0.9	250	254	31,769	2029/6/22		
SPGB 0.05% 01/31/21	0.05	500	502	62,733	2021/1/31	BGB 1% 06/22/26	1.0	1,200	1,260	157,405	2026/6/22		
SPGB 0.4% 04/30/22	0.4	1,770	1,795	224,215	2022/4/30	BGB 1% 06/22/31	1.0	1,360	1,376	171,988	2031/6/22		
SPGB 0.45% 10/31/22	0.45	800	812	101,440	2022/10/31	BGB 1.45% 06/22/37	1.45	400	410	51,248	2037/6/22		
SPGB 0.75% 07/30/21	0.75	1,000	1,022	127,735	2021/7/30	BGB 1.6% 06/22/47	1.6	710	709	88,679	2047/6/22		
SPGB 1.15% 07/30/20	1.15	950	969	121,124	2020/7/30	BGB 1.9% 06/22/38	1.9	330	361	45,134	2038/6/22		
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	1,750	1,798	224,602	2026/10/31	BGB 2.15% 06/22/66	2.15	310	332	41,494	2066/6/22		
SPGB 1.4% 01/31/20	1.4	660	671	83,823	2020/1/31	BGB 2.25% 06/22/23	2.25	970	1,075	134,296	2023/6/22		
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	1,420	1,445	180,595	2028/4/30	BGB 2.25% 06/22/57	2.25	290	322	40,301	2057/6/22		
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	450	455	56,939	2028/7/30	BGB 2.6% 06/22/24	2.6	1,200	1,367	170,798	2024/6/22		
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	2,250	2,312	288,794	2027/10/31	BGB 3% 06/22/34	3.0	500	633	79,175	2034/6/22		
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,200	1,242	155,181	2027/4/30	BGB 3.75% 06/22/45	3.75	620	919	114,831	2045/6/22		
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,250	1,325	165,561	2025/4/30	BGB 3.75% 09/28/20	3.75	1,130	1,209	151,038	2020/9/28		
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	1,560	1,679	209,763	2026/4/30	BGB 4% 03/28/22	4.0	790	899	112,324	2022/3/28		
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,560	1,635	204,262	2030/7/30	BGB 4% 03/28/32	4.0	450	621	77,683	2032/3/28		
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	1,550	1,693	211,575	2025/10/31	BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,240	1,909	238,520	2041/3/28		
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	1,050	1,123	140,358	2033/7/30	BGB 4.25% 09/28/21	4.25	1,250	1,406	175,629	2021/9/28		
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	600	632	78,959	2048/10/31	BGB 4.25% 09/28/22	4.25	1,330	1,552	193,929	2022/9/28		
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	1,900	2,139	267,255	2024/10/31	BGB 4.5% 03/28/26	4.5	950	1,235	154,268	2026/3/28		
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,100	1,216	151,979	2046/10/31	BGB 5% 03/28/35	5.0	1,430	2,244	280,304	2035/3/28		
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	700	832	103,942	2066/7/30	BGB 5.5% 03/28/28	5.5	1,350	1,949	243,540	2028/3/28		
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	1,500	1,761	219,986	2024/4/30	<b>(オーストリア)</b>							
SPGB 4% 04/30/20	4.0	2,650	2,788	348,356	2020/4/30	<b>国債証券</b>							
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,420	1,902	237,645	2037/1/31	RAGB 0% 07/15/23	-	650	656	81,966	2023/7/15		
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	1,320	1,573	196,583	2023/10/31	RAGB 0% 09/20/22	-	270	273	34,109	2022/9/20		
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	1,410	1,765	220,489	2025/7/30	RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	40	41	5,159	2028/2/20		
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,390	2,010	251,084	2041/7/30	RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	1,800	1,874	234,201	2026/10/20		
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	860	1,048	130,918	2024/1/31	RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	810	872	108,948	2025/10/20		
SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	1,000	1,088	135,955	2020/10/31	RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	100	106	13,295	2047/2/20		
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,220	1,801	225,026	2040/7/30	RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	190	185	23,147	2086/11/2		
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	750	1,016	126,965	2028/10/31	RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	650	714	89,205	2024/10/21		
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,040	1,611	201,297	2044/10/31	RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	750	819	102,405	2023/10/20		
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,870	3,472	433,791	2023/1/31	RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	290	352	44,002	2117/9/20		
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	2,740	3,085	385,384	2021/4/30	RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	520	634	79,229	2034/5/23		
						RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	730	1,053	131,622	2044/6/20		

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千ユーロ	千ユーロ	外貨建金額	邦貨換算金額				千ユーロ	千円	千イギリスポンド	千イギリスポンド	
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	670	765	95,576	2022/11/22	UKT 1.25% 07/22/27	1.25	1,390	1,405	199,828	2027/7/22		
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,100	1,214	151,698	2021/9/15	UKT 1.5% 01/22/21	1.5	2,570	2,608	370,879	2021/1/22		
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	570	643	80,358	2022/4/20	UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,150	2,225	316,476	2026/7/22		
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	260	466	58,321	2062/1/26	UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,480	1,407	200,183	2047/7/22		
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	880	935	116,832	2020/7/15	UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,350	1,400	199,215	2028/10/22		
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,000	1,535	191,785	2037/3/15	UKT 1.625% 10/22/71	1.625	160	162	23,078	2071/10/22		
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	950	1,269	158,570	2026/3/15	UKT 1.75% 07/22/57	1.75	500	518	73,699	2057/7/22		
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	370	555	69,379	2027/7/15	UKT 1.75% 09/07/22	1.75	1,640	1,695	241,030	2022/9/7		
<b>(フィンランド)</b>						UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,440	1,464	208,218	2037/9/7		
<b>国債証券</b>						UKT 2% 07/22/20	2.0	2,350	2,393	340,325	2020/7/22		
RFGB 0% 04/15/22	-	250	252	31,586	2022/4/15	UKT 2% 09/07/25	2.0	1,450	1,547	220,062	2025/9/7		
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	420	431	53,871	2026/4/15	UKT 2.25% 09/07/23	2.25	950	1,009	143,589	2023/9/7		
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	180	183	22,872	2027/9/15	UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,350	1,747	248,559	2065/7/22		
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	140	141	17,641	2028/9/15	UKT 2.75% 09/07/24	2.75	420	462	65,717	2024/9/7		
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	350	354	44,329	2031/4/15	UKT 3.25% 01/22/44	3.25	1,550	2,028	288,496	2044/1/22		
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	190	200	25,048	2025/9/15	UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,250	1,713	243,627	2045/1/22		
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	260	272	34,007	2034/4/15	UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,750	2,879	409,524	2068/7/22		
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	170	183	22,937	2047/4/15	UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,110	1,706	242,652	2052/7/22		
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	720	773	96,609	2023/4/15	UKT 3.75% 09/07/20	3.75	890	932	132,550	2020/9/7		
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	380	407	50,842	2022/9/15	UKT 3.75% 09/07/21	3.75	620	667	94,936	2021/9/7		
RFGB 2% 04/15/24	2.0	200	222	27,755	2024/4/15	UKT 4% 01/22/60	4.0	1,000	1,716	244,040	2060/1/22		
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	410	556	69,545	2042/7/4	UKT 4% 03/07/22	4.0	1,750	1,922	273,421	2022/3/7		
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	380	464	57,982	2028/7/4	UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,740	2,436	346,427	2036/3/7		
RFGB 3.375% 04/15/20	3.375	770	805	100,637	2020/4/15	UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,100	1,477	210,076	2032/6/7		
RFGB 3.5% 04/15/21	3.5	720	782	97,773	2021/4/15	UKT 4.25% 09/07/39	4.25	930	1,349	191,959	2039/9/7		
RFGB 4% 07/04/25	4.0	360	452	56,549	2025/7/4	UKT 4.25% 12/07/27	4.25	750	948	134,811	2027/12/7		
<b>(アイルランド)</b>						UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,220	1,794	255,180	2040/12/7		
<b>国債証券</b>						UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,600	2,492	354,407	2046/12/7		
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	450	464	57,984	2022/3/15	UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,060	1,708	242,897	2049/12/7		
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	380	385	48,192	2028/5/15	UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,350	2,325	330,630	2055/12/7		
IRISH 1% 05/15/26	1.0	740	770	96,212	2026/5/15	UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,350	1,907	271,192	2034/9/7		
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	240	244	30,593	2029/5/15	UKT 4.5% 12/07/42	4.5	1,340	2,076	295,347	2042/12/7		
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	660	688	85,948	2037/5/15	UKT 4.75% 03/07/20	4.75	800	834	118,643	2020/3/7		
IRISH 2% 02/18/45	2.0	620	672	84,023	2045/2/18	UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,000	1,375	195,598	2030/12/7		
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	820	945	118,086	2030/5/15	UKT 4.75% 12/07/38	4.75	620	948	134,815	2038/12/7		
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	420	491	61,347	2024/3/18	UKT 5% 03/07/25	5.0	1,600	1,983	282,120	2025/3/7		
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	580	675	84,328	2023/3/20	UKT 6.0% 12/07/28	6.0	450	650	92,492	2028/12/7		
IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	980	1,038	129,734	2020/4/18	UKT 8% 06/07/21	8.0	400	467	66,461	2021/6/7		
IRISH 5% 10/18/20	5.0	440	480	60,043	2020/10/18								
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	950	1,244	155,497	2025/3/13	<b>小 計</b>				8,755,889			
<b>小 計</b>													
<b>(イギリス)</b>						<b>(スウェーデン)</b>							
<b>国債証券</b>						<b>国債証券</b>							
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	950	941	133,822	2022/7/22	SGB 0.75% 05/12/28	0.75	3,200	3,308	39,508	2028/5/12		
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	1,950	1,941	276,044	2023/7/22	SGB 0.75% 11/12/29	0.75	1,980	2,023	24,155	2029/11/12		
UKT 1% 04/22/24	1.0	300	301	42,844	2024/4/22	SGB 1% 11/12/26	1.0	3,210	3,399	40,586	2026/11/12		
						SGB 1.5% 11/13/23	1.5	5,270	5,670	67,708	2023/11/13		

当 期 末						当 期 末							
銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額		評 価 額		償還年月日
		千スウェーデン クローナ	千スウェーデン クローナ	外貨建金額	邦貨換算金額				千円	千円	外貨建金額	邦貨換算金額	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	4,150	4,778	57,059	2025/5/12	ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,450	1,465	114,429	2028/5/21		
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	3,210	4,632	55,316	2039/3/30	ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	590	609	47,625	2030/5/21		
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	7,450	8,381	100,072	2022/6/1	ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,400	1,469	114,761	2024/4/21		
SGB 5% 12/01/20	5.0	6,420	7,056	84,259	2020/12/1	ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	180	183	14,348	2041/5/21		
小 計				468,666		ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	580	606	47,384	2035/6/21		
(ノルウェー) 国債証券		千ノルウェー クローネ	千ノルウェー クローネ			ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,900	2,000	156,235	2027/11/21		
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	3,150	3,139	40,409	2026/2/19	ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,750	1,843	143,995	2028/11/21		
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	2,900	2,927	37,681	2027/2/17	ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,440	1,522	118,860	2029/11/21		
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	1,690	1,717	22,102	2025/3/13	ACGB 3% 03/21/47	3.0	830	880	68,782	2047/3/21		
NGB 2% 04/26/28	2.0	1,500	1,538	19,802	2028/4/26	ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,050	2,216	173,102	2025/4/21		
NGB 2% 05/24/23	2.0	4,550	4,677	60,204	2023/5/24	ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,530	1,684	131,550	2029/4/21		
NGB 3% 03/14/24	3.0	3,550	3,834	49,345	2024/3/14	ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	550	610	47,689	2039/6/21		
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	5,420	5,735	73,810	2021/5/25	ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	820	971	75,867	2037/4/21		
小 計				303,355		ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	2,150	2,479	193,655	2026/4/21		
(デンマーク) 国債証券		千デンマーク クローネ	千デンマーク クローネ			ACGB 4.5% 04/15/20	4.5	1,360	1,402	109,550	2020/4/15		
DGB 0.25% 11/15/20	0.25	4,010	4,069	68,089	2020/11/15	ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,220	1,546	120,729	2033/4/21		
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	2,000	2,071	34,659	2027/11/15	ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,400	2,890	225,687	2027/4/21		
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	3,700	4,022	67,292	2023/11/15	ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	1,820	2,103	164,258	2023/4/21		
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	5,280	5,949	99,527	2025/11/15	ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	2,000	2,180	170,261	2021/5/15		
DGB 3% 11/15/21	3.0	6,200	6,808	113,909	2021/11/15	ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	2,000	2,274	177,599	2022/7/15		
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	9,820	17,352	290,300	2039/11/15	小 計				2,702,947			
小 計				673,779		(シンガポール) 国債証券		千シンガ ポールドル	千シンガ ポールドル				
(ポーランド) 国債証券		千ポーランド ズロチ	千ポーランド ズロチ			SIGB 1.25% 10/01/21	1.25	290	284	23,084	2021/10/1		
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	1,750	1,753	50,959	2020/4/25	SIGB 2% 07/01/20	2.0	320	320	25,966	2020/7/1		
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	2,050	2,059	59,865	2021/7/25	SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	200	200	16,243	2026/6/1		
POLGB 2% 04/25/21	2.0	2,630	2,657	77,246	2021/4/25	SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	720	724	58,775	2021/6/1		
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	2,000	2,029	58,992	2022/4/25	SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	210	203	16,510	2036/8/1		
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	1,040	1,062	30,883	2023/1/25	SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	350	356	28,883	2025/6/1		
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	3,150	3,141	91,316	2026/7/25	SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	70	72	5,891	2028/5/1		
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	1,910	1,890	54,964	2027/7/25	SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	380	390	31,708	2046/3/1		
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	1,560	1,561	45,381	2028/4/25	SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	380	392	31,806	2042/4/1		
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	2,000	2,101	61,081	2025/7/25	SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	500	515	41,820	2023/7/1		
POLGB 4% 10/25/23	4.0	2,870	3,116	90,607	2023/10/25	SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	100	106	8,615	2029/7/1		
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	2,300	2,448	71,171	2020/10/25	SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	370	391	31,783	2030/9/1		
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	900	1,141	33,182	2029/4/25	SIGB 3% 09/01/24	3.0	470	493	40,009	2024/9/1		
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	1,300	1,476	42,914	2022/9/23	SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	320	332	26,971	2022/9/1		
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	1,130	1,252	36,413	2021/10/25	SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	600	611	49,625	2020/9/1		
小 計				804,981		SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	270	301	24,461	2033/9/1		
(オーストラリア) 国債証券		千オースト ラリアドル	千オースト ラリアドル			SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	530	583	47,323	2027/3/1		
ACGB 1.75% 11/21/20	1.75	1,750	1,750	136,680	2020/11/21	小 計				509,480			
ACGB 2% 12/21/21	2.0	1,900	1,919	149,891	2021/12/21	(マレーシア) 国債証券		千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット				
						MCS 3.418% 08/15/22	3.418	2,200	2,180	58,426	2022/8/15		

銘柄	利率	期末			償還年月日
		額面金額	評価額	額	
		千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット	千円	
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	1,300	1,286	34,474	2023/3/15
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	550	550	14,747	2020/3/31
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	670	641	17,204	2027/5/31
MGS 3.62% 11/30/21	3.62	950	951	25,503	2021/11/30
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	860	808	21,671	2033/4/15
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,350	1,358	36,413	2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,200	1,184	31,738	2027/3/15
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	150	150	4,023	2025/9/15
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	750	756	20,278	2024/9/30
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	690	672	18,030	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	1,880	1,906	51,086	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,650	1,676	44,935	2024/7/15
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,050	1,021	27,369	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,650	1,689	45,271	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,900	1,945	52,148	2030/4/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	1,160	1,195	32,029	2037/4/7
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,210	1,244	33,365	2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	950	1,031	27,641	2028/9/15
小計				596,359	
(南アフリカ) 国債証券		千南アフリ カランド	千南アフリ カランド		
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	16,050	17,723	144,090	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	10,300	7,509	61,055	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	7,550	5,396	43,869	2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	3,900	3,877	31,522	2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	8,840	7,417	60,304	2031/2/28

銘柄	利率	期末			償還年月日
		額面金額	評価額	額	
		千南アフリ カランド	千南アフリ カランド	千円	
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	5,300	5,290	43,015	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	8,200	7,566	61,514	2030/1/31
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	5,300	4,865	39,555	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	9,000	8,162	66,362	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	11,600	10,581	86,024	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	11,300	10,299	83,738	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	2,800	2,653	21,570	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	4,850	4,560	37,077	2040/1/31
小計				779,702	
合計				128,961,823	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外 EURO-SCHATZ	237	—
US 5YR NOTE	465	—
EURO-BOBL FU	298	—
EURO-BUND	620	—
US 10YR NOTE	308	—
US LONG BOND	240	—

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

投資信託財産の構成

項目	期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	128,961,823	96.6
コール・ローン等、その他	4,601,327	3.4
投資信託財産総額	133,563,150	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(130,324,851千円)の投資信託財産総額(133,563,150千円)に対する比率は97.6%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

- |                   |                   |                    |
|-------------------|-------------------|--------------------|
| 1米ドル=109.94円      | 1カナダドル=83.19円     | 1メキシコペソ=5.75円      |
| 1ユーロ=124.91円      | 1イギリスポンド=142.20円  | 1スウェーデンクローナ=11.94円 |
| 1ノルウェークローネ=12.87円 | 1デンマーククローネ=16.73円 | 1ポーランドズロチ=29.07円   |
| 1オーストラリアドル=78.09円 | 1シンガポールドル=81.11円  | 1マレーシアリンギット=26.80円 |
| 1南アフリカカランド=8.13円  |                   |                    |

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2019年2月7日現在
(A) 資 産	136,467,709,411円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,245,402,075
公 社 債(評価額)	128,961,823,125
未 収 入 金	2,944,107,623
未 収 利 息	1,115,534,777
前 払 費 用	42,828,582
差 入 委 託 証 拠 金	158,013,229
(B) 負 債	3,010,822,781
未 払 金	2,918,246,855
未 払 解 約 金	92,558,225
未 払 利 息	6,845
そ の 他 未 払 費 用	10,856
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	133,456,886,630
元 本	57,233,519,733
次 期 繰 越 損 益 金	76,223,366,897
(D) 受 益 権 総 口 数	57,233,519,733口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,318円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2018年2月8日 至 2019年2月7日
(A) 配 当 等 収 益	3,365,484,152円
受 取 利 息	3,367,431,946
そ の 他 収 益 金	317,881
支 払 利 息	△2,265,675
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△5,641,305,441
売 買 益	2,227,548,836
売 買 損	△7,868,854,277
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	20,320,352
取 引 益	69,774,372
取 引 損	△49,454,020
(D) そ の 他 費 用	△19,018,050
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△2,274,518,987
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	84,393,289,317
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,573,167,325
(H) 解 約 差 損 益 金	△12,468,570,758
(I) 計 (E+F+G+H)	76,223,366,897
次 期 繰 越 損 益 金(I)	76,223,366,897

(注1) (B) 有価証券売買損益及び(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

#### <注記事項>

※当ファンドの期首元本額は61,636,155,455円、期中追加設定元本額は4,979,769,710円、期中一部解約元本額は9,382,405,432円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC外国債券インデックスファンドL	11,963,502,200円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	8,042,881,038円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	3,699,723,021円
私募外国債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	3,690,707,788円
インデックスコレクション (外国債券)	3,366,425,976円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	2,344,413,204円
外国債券インデックスファンド	2,312,848,895円
外国債券パッシブファンド私募A (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	2,243,026,721円
インデックスコレクション (バランス株式30)	2,115,935,530円
DC外国債券インデックスファンド	1,970,668,905円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	1,962,440,109円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	1,819,669,408円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	1,581,719,289円
外国債券インデックスe	1,412,010,410円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	1,051,128,722円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	888,249,050円
外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	785,168,143円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	777,383,608円
DCバランスファンド30	742,214,955円
DCバランスファンド50	718,140,740円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	474,148,469円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	448,197,570円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	444,699,996円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	385,669,660円
インデックスコレクション (バランス株式50)	355,558,904円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	322,778,363円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	252,299,169円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	243,643,106円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	141,988,463円
DCバランスファンド70	136,461,856円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	126,044,208円
バランスVA20 (適格機関投資家専用)	115,704,494円
インデックスコレクション (バランス株式70)	101,561,241円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	99,591,504円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	62,861,676円
私募外国債券インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	18,218,382円
バランスVA20L (適格機関投資家専用)	14,390,110円
VAバランス株式30 (適格機関投資家専用)	1,444,850円

## お知らせ

---

投資助言に係る記載を削除することに伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2018年4月11日)

当ファンドの委託会社であります三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社は、2018年10月1日付で、三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継いたしました。

なお、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が本件承継前に三井住友信託銀行より受けていた投資助言(関連して三井住友信託銀行株式会社がその他の運用会社等から受けていた投資助言がある場合には同助言を含みます。)については、承継後の運用体制においても実質的に引き継がれております。

このため、本件承継に伴いファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。