

## iシェアーズ 先進国債券 インデックス・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限です。(設定日:2013年9月12日)	
決算日	8月2日(休業日の場合は翌営業日)	
運用方針	<p>①先進国債券インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し委託者の判断により決定するものとします。</p> <p>②効率的な運用を目的として、国債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行なう場合があります。</p> <p>③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、債券の実質投資比率(組入現物債券の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)が100%を超える場合があります。</p> <p>④外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。</p> <p>⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ、エイ。(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の買付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。</p> <p>⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>	
主要運用対象	子投資信託	【iシェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド】 先進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。
	親投資信託	【先進国債券インデックス・マザーファンド】 日本を除く先進国の国債等を主要投資対象とします。
組入制限	<p>■株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>	
分配方針	<p>年1回の毎決算時(原則として8月2日、休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行ないます。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行ないます。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行なわないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。</p>	

### 第6期 運用報告書(全体版) (決算日:2019年8月2日)

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは上記の通り決算を行ないましたので、期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

### ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問合わせ先

電話番号:03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

[www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

## CONTENTS

子投資信託(決算日:2019年8月2日)

「iシェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 資産状況

親投資信託(決算日:2019年8月2日)

「先進国債券インデックス・マザーファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ ファンド状況
- ◇ 運用内容
- ◇ 資産状況

## ◇基準価額の推移

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率	純資産
	(分配落)	税 込 配 金	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率				
2期(2015年8月3日)	円 12,390	円 0	% 12.7		% 13.8	% 98.6	% -	% -	百万円 282
3期(2016年8月2日)	10,766	0	△13.1	243.85	△12.5	98.9	-	-	291
4期(2017年8月2日)	11,578	0	7.5	263.18	7.9	99.0	-	-	321
5期(2018年8月2日)	11,511	0	△0.6	263.09	△0.0	99.0	-	-	332
6期(2019年8月2日)	11,622	0	1.0	266.80	1.4	99.2	-	-	360

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」、「金利先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)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。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。

(注6) 純資産総額の単位未満は切捨て。

## ■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) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期首) 2018年8月2日	円 11,511	-	% -	263.09	% -	% 99.0	% -	% -
8月末	11,458	△0.5		262.08	△0.4	99.1	-	-
9月末	11,649	1.2		266.51	1.3	98.9	-	-
10月末	11,431	△0.7		261.65	△0.5	98.9	-	-
11月末	11,527	0.1		263.95	0.3	98.9	-	-
12月末	11,451	△0.5		262.28	△0.3	99.0	-	-
2019年1月末	11,376	△1.2		260.68	△0.9	99.1	-	-
2月末	11,533	0.2		264.37	0.5	98.9	-	-
3月末	11,684	1.5		267.93	1.8	98.8	-	-
4月末	11,649	1.2		267.17	1.6	98.9	-	-
5月末	11,549	0.3		265.04	0.7	98.9	-	-
6月末	11,699	1.6		268.51	2.1	99.2	-	-
7月末	11,730	1.9		269.29	2.4	98.9	-	-
(期末) 2019年8月2日	11,622	1.0		266.80	1.4	99.2	-	-

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

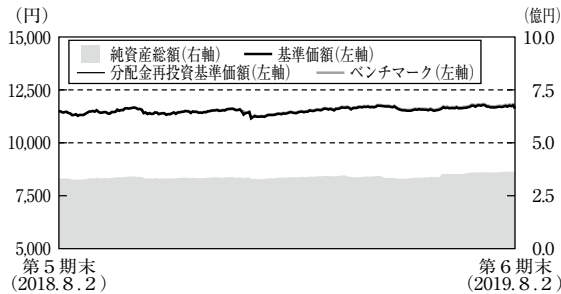
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」、「金利先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)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。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。

## ■当期中の基準価額等の推移について(第6期:2018年8月3日~2019年8月2日)



第6期首：11,511円

第6期末：11,622円(既払分配金0円)

騰落率：1.0%(分配金再投資ベース)

- \* 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)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。
- \* 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、ファンドの購入価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。
- \* ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)です。
- \* 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

## ◇運用担当者コメント

### 投資環境について

当期(2018年8月3日から2019年8月2日)の先進国(除く日本)債券市場は、期初は堅調な米国の経済指標やイタリア財政問題に対する懸念が一時的に後退したことを背景に、米国や欧州債券市場を中心に金利上昇基調となりましたが、その後株式市場が急落し、グローバルで景気の先行き懸念が台頭したことから、先進国金利に低下圧力がかかりました。また、期末にかけて米欧中央銀行が緩和的な姿勢を一段と強めた中、金利は更に低下する展開となりました。

## ポートフォリオについて

### <当ファンド>

先進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た運用を行ないました。

### <先進国債券インデックス・マザーファンド>

日本を除く先進国の国債等を主要投資対象として、日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指し運用を行ないました。組入比率については概ね98%以上を維持しました。

## 基準価額の主な変動要因

当期、当ファンドの基準価額は+1.0%の上昇となりました。為替についてはドル円・ユーロ円共に通期を通じて上昇し、先進国金利が低下したことにより基準価格は上昇しました。米中貿易摩擦の激化に対する懸念の高まりや軟調なグローバルの経済指標を背景に、先進国の中央銀行は緩和的な金融政策を実施する可能性を示唆したことを背景に、金利は低下する展開となりました。

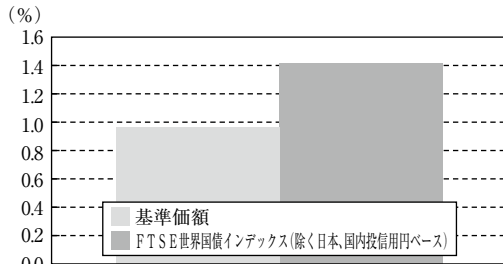
## ■組入ファンドの当期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
先進国債券インデックス・マザーファンド	1.4%

## ベンチマークとの差異について

当期、当ファンドの基準価額は+1.0%の上昇となりました。また、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)は+1.4%の上昇となりました。ベンチマークとの差異については、当ファンドにおいて信託報酬等コスト負担が発生することなどがマイナス要因となりました。

## 【基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)】



第6期  
(2018.8.3 ~ 2019.8.2)

## 【分配金について】

収益分配は基準価額水準、市場動向等を勘案して、見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行いません。

## ■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2018年8月3日 ~2019年8月2日
当期分配金(税込み)	-円
対基準価額比率	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	2,239

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。  
また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)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。

## 【今後の運用方針について】

## ＜当ファンド＞

当ファンドの運用方針に従い、先進国債券インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

## ＜先進国債券インデックス・マザーファンド＞

日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

## ◇ファンド状況

## ■1万口当りの費用明細

項目	第6期 (2018.8.3~2019.8.2)		項目の概要
	金額	比率	
	円	%	
(a) 信託報酬	40	0.351	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11,529円です。
(投信会社)	(19)	(0.162)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(19)	(0.162)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.027)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	14	0.123	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)	(3)	(0.022)	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および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(12)	(0.100)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	55	0.474	

(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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

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

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2018年8月3日から2019年8月2日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
先進国債券インデックス・マザーファンド	71,960	86,167	53,136	63,674

(注) 単位未満は切捨て。

## ■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2018年8月3日から2019年8月2日まで)

当期における株式の売買はありません。

## ■利害関係人との取引状況(2018年8月3日から2019年8月2日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

(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

銘	柄	期 首(前期末)	当 期		末
		口 数	口 数	評 価	額
		千口	千口		千円
先進国債券インデックス・マザーファンド		280,089	298,914		360,849

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の受益権総口数は13,767,117千口です。

## ◇資産状況

## ■投資信託財産の構成

2019年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
先進国債券インデックス・マザーファンド	360,849	100.0
コール・ローン等、その他	12	0.0
投資信託財産総額	360,861	100.0

(注1) 先進国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(16,609,678千円)の投資信託財産総額(16,822,926千円)に対する比率は、98.7%です。

(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=107.17円、1カナダ・ドル=81.07円、1オーストラリア・ドル=72.98円、1シンガポール・ドル=77.90円、1英国・ポンド=130.10円、1デンマーク・クローネ=15.91円、1ノルウェー・クローネ=12.07円、1スウェーデン・クローナ=11.09円、1メキシコ・ペソ=5.58円、1マレーシア・リンギット=25.81円、1南アフリカ・ランド=7.32円、1ポーランド・ズロチ=27.58円、1ユーロ=118.82円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	360,861,805円
先進国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	360,849,565
未 収 入 金	12,240
(B) 負 債	762,338
未 払 解 約 金	12,240
未 払 信 託 報 酬	592,517
そ の 他 未 払 費 用	157,581
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	360,099,467
元 本	309,851,425
次 期 繰 越 損 益 金	50,248,042
(D) 受 益 権 総 口 数	309,851,425口
1万口当り基準価額(C/D)	11,622円

<注記事項>

期首元本額	288,988,196円
期中追加設定元本額	74,941,310円
期中一部解約元本額	54,078,081円

## ■損益の状況

自2018年8月3日 至2019年8月2日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,666,037円
売 買 益	5,346,462
売 買 損	△ 680,425
(B) 信 託 報 酬 等	△ 1,530,672
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	3,135,365
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 505,550
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	47,618,227
(配 当 等 相 当 額)	( 40,266,899)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 7,351,328)
(F) 計 (C+D+E)	50,248,042
次 期 繰 越 損 益 金(F)	50,248,042
追 加 信 託 差 損 益 金	47,618,227
(配 当 等 相 当 額)	( 40,453,426)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 7,164,801)
分 配 準 備 積 立 金	26,094,113
繰 越 損 益 金	△23,464,298

(注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

**■当期の分配金**

当期の分配金は見送らせていただきました。

(注) 第6期計算期末における、費用控除後の配当等収益(7,464,956円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(2,835,210円)、収益調整金(その他収益調整金)(40,453,426円)、分配準備積立金(18,629,157円)により、分配対象収益は69,382,749円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。



## 運用報告書

－第6期－ 決算日 2019年8月2日  
計算期間(2018年8月3日～2019年8月2日)

### 先進国債券インデックス・マザーファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

決 算 日	8月2日(原則)
運 用 方 針	<p>①日本を除く先進国の国債市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。対象指数の選定および変更に当たっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。</p> <p>②効率的な運用を目的として、国債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行なう場合があります。</p> <p>③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、債券の実質投資比率(組入現物債券の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)が100%を超える場合があります。</p> <p>④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。</p> <p>⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ、(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の貸付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。</p> <p>⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>
主要運用対象	日本を除く先進国の国債等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	<p>■株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

## ◇基準価額の推移

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率	純資産
	円	%	騰落率	%				
2期(2015年8月3日)	12,554	13.5	278.74	13.8	98.2	-	-	2,859
3期(2016年8月2日)	10,990	△12.5	243.85	△12.5	98.5	-	-	5,247
4期(2017年8月2日)	11,902	8.3	263.18	7.9	98.6	-	-	7,271
5期(2018年8月2日)	11,903	0.0	263.09	△0.0	98.7	-	-	9,747
6期(2019年8月2日)	12,072	1.4	266.80	1.4	99.0	-	-	16,619

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)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。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。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

## ■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) FTSE世界国債インデックス (除く日本、国内投信用円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	金利先物 組入比率
	円	%	騰落率	%			
(期首) 2018年8月2日	11,903	-	263.09	-	98.7	-	-
8月末	11,853	△0.4	262.08	△0.4	99.1	-	-
9月末	12,054	1.3	266.51	1.3	98.8	-	-
10月末	11,834	△0.6	261.65	△0.5	98.8	-	-
11月末	11,938	0.3	263.95	0.3	98.7	-	-
12月末	11,863	△0.3	262.28	△0.3	98.8	-	-
2019年1月末	11,791	△0.9	260.68	△0.9	98.9	-	-
2月末	11,957	0.5	264.37	0.5	98.9	-	-
3月末	12,118	1.8	267.93	1.8	98.7	-	-
4月末	12,086	1.5	267.17	1.6	98.8	-	-
5月末	11,988	0.7	265.04	0.7	98.8	-	-
6月末	12,147	2.0	268.51	2.1	99.1	-	-
7月末	12,184	2.4	269.29	2.4	98.7	-	-
(期末) 2019年8月2日	12,072	1.4	266.80	1.4	99.0	-	-

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

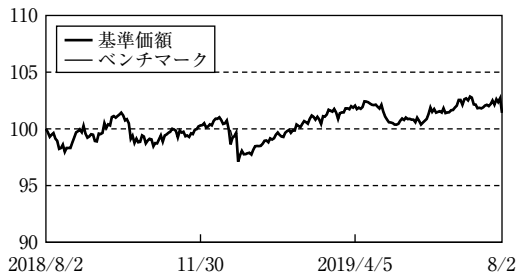
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) FTSE世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)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。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。

## ■基準価額の推移

(2018年8月2日～2019年8月2日)



(注1) 前期末を100とした指数値を使用しています。

(注2) ベンチマークは、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、国内投信用円ベース)です。

## ◇ファンド状況

## ■1万口当りの費用明細

項目	当期
(a) 売買委託手数料	円 -
(b) 有価証券取引税	-
(c) その他費用 (保管費用)	3 (3)
(その他)	(0)
合計	3

(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、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数

(b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数

(c) その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数

(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

## ◇運用内容

## ■売買及び取引の状況(2018年8月3日から2019年8月2日まで)

公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千米・ドル 90,748	千米・ドル 59,437
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 4,939	千カナダ・ドル 3,545
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 5,010	千オーストラリア・ドル 3,403
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 824	千シンガポール・ドル 432
	イギリス	国債証券	千英国・ポンド 9,344	千英国・ポンド 6,503
	スイス	国債証券	千スイス・フラン -	千スイス・フラン 60
国	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 5,925	千デンマーク・クローネ 4,291
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 2,729	千ノルウェー・クローネ 1,197
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 5,512	千スウェーデン・クローナ 3,653

			買 付 額	売 付 額
外	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 25,279	千メキシコ・ペソ 17,323
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 2,851	千マレーシア・リンギット 1,715
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカ・ランド 12,984	千南アフリカ・ランド 7,584
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 3,787	千ポーランド・ズロチ 2,408
国	ユ	ア イ ル ラ ン ド	千ユーロ 1,177	千ユーロ 848
		オ ラ ン ダ	3,286	2,244 ( 115)
	ロ	ベ ル ギ ー	3,985	2,640
		フ ラ ン ス	16,940	11,566
		ド イ ツ	11,689	8,223
		ス ペ イ ン	9,448	6,535
		イ タ リ ア	14,555	10,102
		フ ィ ン ラ ン ド	862	545
		オ ー ス ト リ ア	2,508	1,815
		ユ ー ロ 通 貨 計	64,455	44,523 ( 115)

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) ( )内は、償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) ユーロの国名は発行国です。

## ■主要な売買銘柄(2018年8月3日から2019年8月2日まで)

### 公社債

当			期		
買	付	金額	売	付	金額
銘	柄		銘	柄	
		千円			千円
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.5% 2041/4/25		197,211	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.625% 2020/06/30		154,628
US TREASURY N/B 5.25%		193,670	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.625% 2026/05/15		145,703
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2% 2023/02/15		163,549	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.5% 2041/4/25		144,642
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 2.5% 2030/05/25		162,492	US TREASURY N/B 5.25%		143,981
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 5.25% 2029/2/15		139,024	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.5% 2022/01/31		131,834
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.625% 2022/11/15		138,767	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.375% 2020/04/30		106,642
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.625% 2026/05/15		126,743	UNITED KINGDOM GILT 4.25% 2040/12/7		104,544
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 3.125% 2044/08/15		122,467	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 3.375% 2019/11/15		97,016
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.5% 2026/03/01		121,499	BUONI POLIENNALI DEL TES		96,473
BTPS 5.25%		121,329	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK 5.625% 2028/1/4		94,979

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産の明細

公社債

(A) 種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ア メ リ カ	千米・ドル 69,894	千米・ドル 73,760	千円 7,904,947	47.6	% -	% 20.7	% 16.8	% 10.0	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 3,488	千カナダ・ドル 3,945	319,865	1.9	-	1.0	0.5	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 3,862	千オーストラリア・ドル 4,474	326,540	2.0	-	1.3	0.4	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 839	千シンガポール・ドル 882	68,753	0.4	-	0.2	0.1	0.1	
イギリス	千英国・ポンド 5,707	千英国・ポンド 7,756	1,009,081	6.1	-	4.9	0.8	0.3	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 3,940	千デンマーク・クローネ 5,311	84,506	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 3,130	千ノルウェー・クローネ 3,250	39,228	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 4,290	千スウェーデン・クローナ 4,848	53,767	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 22,000	千メキシコ・ペソ 22,357	124,754	0.8	-	0.5	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 2,830	千マレーシア・リンギット 2,921	75,402	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 13,075	千南アフリカ・ランド 12,191	89,239	0.5	-	0.5	0.0	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 3,258	千ポーランド・ズロチ 3,418	94,274	0.6	-	0.2	0.2	0.1	
ユ ロ 小 計	千ユーロ	千ユーロ							
	アイルランド	840	987	117,318	0.7	-	0.5	0.1	0.0
	オランダ	2,057	2,608	309,889	1.9	-	1.1	0.7	0.0
	ベルギー	2,535	3,489	414,614	2.5	-	1.8	0.6	0.1
	フランス	10,475	13,847	1,645,377	9.9	-	6.7	2.5	0.7
	ドイツ	7,146	8,942	1,062,604	6.4	-	3.7	1.4	1.3
	スペイン	5,761	7,823	929,598	5.6	-	3.8	1.5	0.3
	イタリア	9,938	12,257	1,456,397	8.8	-	5.5	2.6	0.6
フィンランド	718	803	95,443	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
オーストリア	1,416	1,932	229,596	1.4	-	1.0	0.3	0.0	
ユ ー ロ 小 計	40,886	52,691	6,260,840	37.7	-	24.6	9.9	3.1	
合 計	-	-	16,451,203	99.0	-	54.9	29.5	14.6	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面、評価額の単位未満は切捨て。

(B) 詳細開示(個別銘柄別)  
外国(外貨建)公社債

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.2500	2040/11/15	235	312	33,508
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2023/12/31	400	409	43,892
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/12/31	400	402	43,174
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2023/10/31	750	748	80,198
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2024/02/15	210	219	23,555
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2025/09/30	700	751	80,519
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.6250	2044/02/15	300	368	39,464
US TREASURY N/B	6.5000	2026/11/15	495	654	70,111
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/08/31	610	613	65,733
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/02/28	570	571	61,263
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2026/01/31	400	421	45,143
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2026/08/15	500	490	52,599
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2025/11/15	159	163	17,545
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2021/04/30	500	504	54,020
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2025/08/15	710	720	77,252
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2046/05/15	347	351	37,636
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/05/15	710	703	75,383
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2020/11/15	250	249	26,761
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2027/11/15	710	732	78,509
UNITED STATES TREASURY	8.0000	2021/11/15	330	375	40,274
UNITED STATES TREASURY	6.2500	2023/08/15	900	1,060	113,625
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.6250	2040/02/15	100	139	14,912
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2020/09/30	35	35	3,755
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/11/15	700	730	78,324
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2020/07/31	350	348	37,390
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2020/11/30	210	210	22,554
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2021/05/15	480	491	52,655
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2020/08/31	680	685	73,419
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2027/08/15	580	598	64,144
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2047/08/15	272	288	30,950
US TREASURY N/B	6.1250	2027/11/15	573	762	81,701
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.3750	2031/02/15	80	108	11,627
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2025/05/15	800	817	87,617
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2045/05/15	530	589	63,125
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2022/11/15	600	599	64,198
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.5000	2028/08/15	650	846	90,759
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/11/15	380	382	40,999
US TREASURY N/B	6.2500	2030/05/15	240	341	36,598
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2024/07/31	250	255	27,347
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2022/06/30	145	146	15,738
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2046/08/15	100	96	10,304
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2021/10/15	450	461	49,430
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2023/10/31	300	314	33,715

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2025/10/31	190	204	21,868
US TREASURY N/B	5.2500	2028/11/15	595	766	82,133
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2025/12/31	200	210	22,562
US TREASURY N/B	6.0000	2026/02/15	635	800	85,833
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	5.2500	2029/02/15	630	815	87,392
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2043/05/15	500	543	58,248
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2023/05/15	150	150	16,115
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2022/12/31	450	456	48,949
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2021/09/15	500	510	54,746
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.7500	2041/08/15	395	492	52,756
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2024/09/30	500	510	54,721
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2021/05/15	550	558	59,825
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2028/05/15	140	151	16,238
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2048/05/15	450	513	55,034
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.7500	2043/11/15	246	307	32,974
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2023/06/30	820	810	86,876
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2042/11/15	220	234	25,122
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2021/03/15	500	504	54,084
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2046/11/15	373	405	43,500
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2026/11/15	780	791	84,829
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2021/05/31	555	551	59,062
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2046/02/15	367	371	39,818
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2026/02/15	310	307	32,943
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2023/05/31	600	598	64,183
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2023/07/31	560	550	59,020
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2021/07/31	900	889	95,303
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2020/11/15	530	535	57,359
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.3750	2040/05/15	210	283	30,387
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2028/02/15	112	120	12,860
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2048/02/15	520	579	62,095
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2024/08/15	392	404	43,389
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2044/08/15	500	566	60,741
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2023/02/15	750	758	81,259
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2022/01/31	275	273	29,333
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/01/31	500	502	53,806
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.7500	2041/02/15	350	496	53,219
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2023/02/28	410	407	43,675
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2021/02/28	400	395	42,419
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2021/11/30	590	590	63,289
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2020/12/31	500	499	53,523
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/01/31	440	450	48,313
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2049/02/15	325	363	38,903
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2027/02/15	340	350	37,600
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/10/31	280	281	30,193
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2021/03/31	435	438	46,968

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2021/04/30	500	496	53,218
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.5000	2039/08/15	50	68	7,336
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2045/08/15	440	478	51,240
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2047/02/15	400	445	47,794
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/05/31	500	519	55,698
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2042/08/15	160	170	18,287
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/10/31	280	281	30,192
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2021/07/31	410	414	44,377
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2022/10/31	390	393	42,214
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/10/31	780	801	85,897
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2021/01/15	500	501	53,722
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2041/11/15	220	250	26,794
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2022/11/30	400	404	43,313
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2020/06/30	338	336	36,108
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/05/31	700	703	75,431
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2020/10/31	190	188	20,242
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2020/11/30	130	131	14,096
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2023/11/30	300	314	33,748
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2025/11/30	500	533	57,186
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2048/08/15	175	195	20,923
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2028/08/15	230	249	26,709
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2021/08/15	980	999	107,142
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2021/01/31	640	635	68,149
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2023/01/31	310	310	33,305
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2021/08/15	810	816	87,478
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2020/06/30	60	59	6,423
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2020/10/15	80	79	8,550
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2023/06/30	500	517	55,506
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2025/06/30	500	528	56,648
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2025/02/28	100	105	11,308
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2023/04/30	365	364	39,041
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2025/08/31	200	211	22,679
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2042/05/15	66	73	7,870
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.2500	2021/03/31	500	495	53,109
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.5000	2023/03/31	777	772	82,750
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2023/08/31	700	691	74,136
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2021/08/31	500	493	52,923
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2022/08/15	410	409	43,870
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2024/03/31	310	316	33,875
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2025/03/31	300	314	33,718
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2023/08/15	500	515	55,297
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2045/11/15	390	433	46,496
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2021/07/15	900	915	98,068
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.8750	2040/08/15	245	310	33,266
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.1250	2021/09/30	50	49	5,291



銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
<b>(アメリカ)</b>	%		千米・ドル	千米・ドル	千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2023/09/30	290	286	30,699
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.3750	2041/05/15	108	146	15,676
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2020/07/31	500	503	53,944
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/07/31	200	208	22,316
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.6250	2043/08/15	285	349	37,459
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2025/07/31	380	404	43,361
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2020/08/15	240	241	25,905
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.6250	2021/06/15	300	304	32,665
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	4.3750	2039/11/15	175	235	25,284
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2026/02/28	140	146	15,694
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2042/02/15	100	113	12,173
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2021/01/31	210	210	22,605
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.3750	2044/05/15	249	293	31,505
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/02/28	760	763	81,811
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2045/02/15	630	638	68,421
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2043/02/15	474	537	57,566
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2025/02/15	340	345	36,978
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2027/05/15	100	104	11,159
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2047/05/15	360	401	42,975
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.7500	2023/04/30	200	207	22,261
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.8750	2025/04/30	220	233	25,060
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2024/06/30	370	375	40,233
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.5000	2025/01/31	300	312	33,483
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/12/31	310	318	34,160
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2021/04/15	750	757	81,171
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2022/07/31	270	272	29,209
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2020/09/30	280	278	29,832
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.1250	2028/11/15	200	221	23,704
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.3750	2048/11/15	364	435	46,691
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	3.0000	2044/11/15	670	743	79,690
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.2500	2024/11/15	112	115	12,333
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.6250	2020/11/30	300	299	32,061
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.3750	2020/12/31	500	503	53,990
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.1250	2021/06/30	310	312	33,459
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2022/02/28	300	300	32,198
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.3750	2020/08/31	400	397	42,621
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/08/31	360	362	38,806
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.7500	2022/05/31	700	701	75,147
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	1.8750	2022/04/30	215	216	23,153
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2.0000	2024/04/30	470	476	51,087
小 計	-	-	69,894	73,760	7,904,947
<b>(カナダ)</b>			千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
CANADA-GOV'T	8.0000	2027/06/01	191	283	23,008
CANADIAN GOVERNMENT BOND	3.5000	2045/12/01	168	233	18,956
CANADIAN GOVERNMENT BOND	3.5000	2020/06/01	264	267	21,720

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
<b>(カナダ)</b>	%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.7500	2020/05/01	65	65	5,272
CANADA-GOV'T	5.7500	2029/06/01	269	374	30,399
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.0000	2022/09/01	135	133	10,797
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.7500	2023/03/01	60	60	4,919
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.2500	2025/06/01	100	104	8,496
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.0000	2028/06/01	20	20	1,702
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.0000	2051/12/01	80	87	7,071
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/06/01	242	242	19,685
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.5000	2026/06/01	300	302	24,491
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.2500	2024/03/01	30	31	2,524
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.7500	2048/12/01	124	155	12,636
CANADIAN GOVERNMENT BOND	3.2500	2021/06/01	80	82	6,686
CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	143	217	17,666
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.7500	2021/03/01	10	9	800
CANADIAN GOVERNMENT BOND	2.5000	2024/06/01	258	271	21,997
CANADIAN GOVERNMENT BOND	1.7500	2020/08/01	240	240	19,475
CANADA-GOV'T	4.0000	2041/06/01	139	198	16,086
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.7500	2020/09/01	320	316	25,695
CANADIAN GOVERNMENT BOND	0.5000	2022/03/01	250	243	19,774
小 計	-	-	3,488	3,945	319,865
<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	
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	4.5000	2033/04/21	190	264	19,337
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.2500	2028/05/21	210	228	16,690
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.0000	2047/03/21	48	59	4,357
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.2500	2022/11/21	270	282	20,612
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2035/06/21	42	49	3,619
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.2500	2039/06/21	130	164	12,039
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	5.5000	2023/04/21	253	296	21,608
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.0000	2021/12/21	120	123	8,994
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.2500	2029/04/21	180	213	15,589
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	5.7500	2021/05/15	264	286	20,932
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2041/05/21	90	106	7,757
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	4.7500	2027/04/21	275	349	25,470
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/11/21	425	482	35,225
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/04/21	170	191	13,985
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2027/11/21	290	326	23,831
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	1.7500	2020/11/21	140	141	10,326
AUSTRALIAN GOVT.	4.5000	2020/04/15	50	51	3,738
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	4.2500	2026/04/21	309	373	27,247
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/07/15	115	131	9,593
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	3.7500	2037/04/21	136	182	13,286
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND	2.7500	2024/04/21	155	168	12,293
小 計	-	-	3,862	4,474	326,540
<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	
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.2500	2021/06/01	78	78	6,131

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
<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 GOVERNMENT BOND	2.0000	2024/02/01	50	50	3,934
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	3.3750	2033/09/01	80	91	7,155
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.7500	2023/07/01	30	31	2,424
SINGAPORE GOV'T	3.1250	2022/09/01	41	42	3,327
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	1.2500	2021/10/01	50	49	3,857
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.6250	2028/05/01	30	31	2,467
SINGAPORE GOV'T	3.2500	2020/09/01	40	40	3,162
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.7500	2046/03/01	22	23	1,839
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	1.7500	2022/04/01	40	40	3,117
SINGAPORE GOV'T	2.8750	2030/09/01	30	32	2,530
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	3.0000	2024/09/01	47	49	3,874
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.8750	2029/07/01	20	21	1,687
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.1250	2026/06/01	30	30	2,380
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.3750	2025/06/01	20	20	1,607
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	1.7500	2023/02/01	70	70	5,453
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	2.7500	2042/04/01	75	81	6,339
SINGAPORE GOV'T	3.5000	2027/03/01	86	95	7,464
小 計	-	-	839	882	68,753
<b>(イギリス)</b>			千英国・ポンド	千英国・ポンド	
UNITED KINGDOM GILT	6.0000	2028/12/07	91	136	17,716
UNITED KINGDOM GILT	1.6250	2028/10/22	335	366	47,657
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2036/03/07	142	211	27,544
UNITED KINGDOM GILT	2.2500	2023/09/07	175	188	24,534
UNITED KINGDOM GILT	1.5000	2021/01/22	61	61	8,061
UNITED KINGDOM GILT	2.0000	2020/07/22	173	175	22,831
UNITED KINGDOM GILT	3.5000	2045/01/22	335	498	64,819
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2040/12/07	135	212	27,700
UNITED KINGDOM GILT	5.0000	2025/03/07	295	370	48,200
TREASURY	4.2500	2046/12/07	189	319	41,508
UNITED KINGDOM GILT	4.7500	2020/03/07	160	164	21,341
TREASURY	4.2500	2032/06/07	90	127	16,594
UNITED KINGDOM GILT	1.7500	2022/09/07	192	200	26,066
TREASURY	4.7500	2030/12/07	155	223	29,095
UNITED KINGDOM GILT	2.7500	2024/09/07	30	33	4,374
UNITED KINGDOM GILT	1.0000	2024/04/22	300	309	40,202
UNITED KINGDOM GILT	1.2500	2027/07/22	308	326	42,443
UNITED KINGDOM GILT	0.7500	2023/07/22	150	152	19,824
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2039/09/07	147	228	29,735
UNITED KINGDOM GILT	2.5000	2065/07/22	57	82	10,773
UNITED KINGDOM GILT	3.7500	2052/07/22	33	55	7,193
TREASURY	4.2500	2027/12/07	78	102	13,280
UNITED KINGDOM GILT	3.5000	2068/07/22	347	637	82,977
TSY	4.7500	2038/12/07	94	153	19,986
UNITED KINGDOM GILT	0.5000	2022/07/22	201	201	26,275
TREASURY	4.0000	2060/01/22	105	198	25,770

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
<b>(イギリス)</b>	%		千英国・ポンド	千英国・ポンド	千円
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2049/12/07	235	411	53,552
UNITED KINGDOM GILT	1.5000	2026/07/22	222	238	31,031
UNITED KINGDOM GILT	4.5000	2042/12/07	291	484	63,075
UK TSY I/L GILT	4.5000	2034/09/07	178	266	34,692
UNITED KINGDOM GILT	1.7500	2057/07/22	80	92	12,061
UNITED KINGDOM GILT	4.2500	2055/12/07	142	267	34,746
UNITED KINGDOM GILT	3.2500	2044/01/22	181	256	33,409
小 計	-	-	5,707	7,756	1,009,081
<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	
DENMARK GOVERNMENT BOND	0.5000	2027/11/15	710	773	12,303
DENMARK GOVERNMENT BOND	0.2500	2020/11/15	480	486	7,740
DENMARK GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/11/15	350	383	6,105
DENMARK GOVERNMENT BOND	3.0000	2021/11/15	885	962	15,313
DENMARK - BULLET	4.5000	2039/11/15	1,190	2,330	37,072
DENMARK GOVERNMENT BOND	1.7500	2025/11/15	325	375	5,971
小 計	-	-	3,940	5,311	84,506
<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	
NORWAY GOVERNMENT BOND	2.0000	2023/05/24	840	862	10,416
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.7500	2025/03/13	370	379	4,583
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.5000	2026/02/19	230	233	2,816
NORWAY GOVERNMENT BOND	3.0000	2024/03/14	370	398	4,812
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.7500	2027/02/17	370	382	4,612
NORWAY GOVERNMENT BOND	2.0000	2028/04/26	200	211	2,548
NORWAY GOVERNMENT BOND	3.7500	2021/05/25	550	574	6,931
NORWAY GOVERNMENT BOND	1.7500	2029/09/06	200	207	2,505
小 計	-	-	3,130	3,250	39,228
<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	
SWEDEN GOVERNMENT BOND	3.5000	2022/06/01	970	1,085	12,042
SWEDEN GOVERNMENT BOND	0.7500	2029/11/12	450	491	5,452
SWEDEN GOVERNMENT BOND	0.7500	2028/05/12	580	633	7,019
SWEDEN GOVERNMENT BOND	5.0000	2020/12/01	640	687	7,629
SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	230	367	4,070
SWEDEN GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/11/12	530	584	6,482
SWEDEN GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/11/13	570	622	6,899
SWEDEN GOVERNMENT BOND	2.5000	2025/05/12	320	376	4,172
小 計	-	-	4,290	4,848	53,767
<b>(メキシコ)</b>			千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	
MEXICAN BONOS	7.7500	2034/11/23	1,000	1,005	5,611
MEXICAN BONOS	7.7500	2042/11/13	2,200	2,172	12,120
MEXICAN BONOS	8.0000	2047/11/07	1,000	1,012	5,650
MEXICAN BONOS	5.0000	2019/12/11	800	790	4,409
MEXICAN BONOS	7.7500	2031/05/29	2,000	2,024	11,297
MEXICAN BONOS	10.0000	2036/11/20	800	969	5,409
MEXICAN BONOS	6.5000	2021/06/10	2,800	2,756	15,382
MEXICAN BONOS	6.5000	2022/06/09	1,000	979	5,466

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
<b>(メキシコ)</b>	%		千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円
MEXICAN BONOS	7.5000	2027/06/03	2,500	2,507	13,992
MEXICAN BONOS	8.0000	2023/12/07	2,700	2,769	15,452
MEXICAN BONOS	5.7500	2026/03/05	1,300	1,189	6,636
MEXICANBONOS	8.5000	2038/11/18	700	746	4,163
MEXICAN BONOS	10.0000	2024/12/05	2,000	2,237	12,486
MEXICAN BONOS	7.2500	2021/12/09	1,200	1,196	6,676
小 計	-	-	22,000	22,357	124,754
<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	
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.4180	2022/08/15	90	90	2,326
MALAYSIAN GOV'T	5.2480	2028/09/15	130	145	3,764
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.9550	2025/09/15	200	204	5,271
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.9350	2043/09/30	70	78	2,024
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.0590	2024/09/30	70	71	1,854
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.0480	2021/09/30	200	203	5,245
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.1600	2021/07/15	200	203	5,249
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.7620	2037/04/07	80	87	2,265
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.1810	2024/07/15	150	154	3,996
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.4980	2030/04/15	100	106	2,748
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8000	2023/08/17	100	101	2,615
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.2540	2035/05/31	190	197	5,096
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.4800	2023/03/15	170	170	4,400
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.1270	2032/04/15	390	401	10,363
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8990	2027/11/16	220	223	5,778
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.9000	2026/11/30	200	203	5,260
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	3.8920	2027/03/15	200	203	5,245
MALAYSIA GOVERNMENT BOND	4.3920	2026/04/15	70	73	1,892
小 計	-	-	2,830	2,921	75,402
<b>(南アフリカ)</b>			千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	7.7500	2023/02/28	785	791	5,791
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	8.7500	2048/02/28	1,940	1,715	12,559
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	9.0000	2040/01/31	870	803	5,878
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	6.2500	2036/03/31	650	468	3,430
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	7.0000	2031/02/28	1,100	927	6,786
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	10.5000	2026/12/21	2,170	2,420	17,717
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	8.8750	2035/02/28	800	750	5,491
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	8.2500	2032/03/31	700	642	4,701
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	8.7500	2044/01/31	1,500	1,335	9,772
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	8.5000	2037/01/31	1,300	1,164	8,523
SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND	8.0000	2030/01/31	1,260	1,173	8,587
小 計	-	-	13,075	12,191	89,239
<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	
POLAND GOVT BOND	5.7500	2022/09/23	200	224	6,191
POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	520	565	15,606
POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	310	332	9,162
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	263	270	7,471

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				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 GOVERNMENT BOND	2.0000	2021/04/25	280	282	7,790
POLAND GOVERNMENT BOND	1.7500	2021/07/25	360	361	9,962
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	300	308	8,517
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.2500	2022/04/25	300	304	8,400
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2023/01/25	340	348	9,611
POLAND GOVT BOND	5.7500	2029/04/25	55	72	2,003
REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	330	346	9,556
小 計	-	-	3,258	3,418	94,274
<b>(ユーロ・・・アイルランド)</b>			千ユーロ	千ユーロ	
IRELAND GOVERNMENT BOND	3.9000	2023/03/20	50	58	6,891
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.8000	2022/03/15	30	31	3,687
IRELAND GOVERNMENT BOND	2.4000	2030/05/15	82	101	12,060
IRELAND GOVERNMENT BOND	2.0000	2045/02/18	64	81	9,653
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/05/15	20	21	2,570
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.7000	2037/05/15	100	117	13,999
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2022/10/18	69	70	8,329
IRELAND GOVERNMENT BOND	0.9000	2028/05/15	100	108	12,864
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3500	2031/03/18	70	78	9,354
IRELAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2050/05/15	15	16	2,013
IRELAND GOVERNMENT BOND	5.4000	2025/03/13	180	238	28,284
IRELAND GOVERNMENT BOND	5.0000	2020/10/18	60	64	7,609
<b>(ユーロ・・・オランダ)</b>					
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.7500	2028/07/15	100	110	13,153
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.5000	2040/01/15	40	43	5,182
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.7500	2047/01/15	137	235	28,041
NETHERLANDS GOVT	7.5000	2023/01/15	83	107	12,729
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	1.7500	2023/07/15	165	181	21,579
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.5000	2033/01/15	129	176	20,946
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.2500	2025/07/15	154	162	19,250
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.0000	2024/07/15	200	227	26,972
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2022/01/15	271	276	32,804
NETHERLANDS GOVT	5.5000	2028/01/15	206	312	37,120
NETHERLANDS GOVT	3.7500	2042/01/15	107	196	23,379
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.0000	2024/01/15	230	237	28,183
NETHERLANDS GOVT	3.5000	2020/07/15	40	41	4,940
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	2.2500	2022/07/15	5	5	648
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.7500	2027/07/15	20	21	2,612
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	4.0000	2037/01/15	140	240	28,564
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	0.2500	2029/07/15	30	31	3,778
<b>(ユーロ・・・ベルギー)</b>					
BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.2500	2021/09/28	132	146	17,364
BELGIUM GOVERNMENT BOND	3.7500	2045/06/22	122	214	25,526
BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	350	526	62,564
BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	230	399	47,452
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.2500	2057/06/22	85	121	14,405

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				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 GOVERNMENT BOND	4.2500	2022/09/28	200	231	27,523
BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/03/28	64	72	8,561
BELGIUM GOVERNMENT BOND	3.7500	2020/09/28	140	147	17,475
BELGIUM GOVERNMENT BOND	3.0000	2034/06/22	40	56	6,731
BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.6000	2024/06/22	120	138	16,504
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.5000	2024/10/22	117	123	14,660
BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.5000	2026/03/28	200	266	31,685
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT BOND	1.4500	2037/06/22	100	118	14,129
BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.0000	2032/03/28	200	300	35,722
BELGIUM GOVERNMENT BOND	4.2500	2041/03/28	220	390	46,409
BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.2500	2023/06/22	5	5	662
BELGIUM GOVERNMENT BOND	2.1500	2066/06/22	30	42	5,099
BELGIUM GOVERNMENT BOND	0.2000	2023/10/22	180	186	22,135
<b>(ユーロ・・・フランス)</b>					
FRANCE O.A.T.	5.5000	2029/04/25	657	1,029	122,284
FRANCE O.A.T.	8.5000	2023/04/25	400	539	64,088
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	3.5000	2026/04/25	476	606	72,097
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2023/03/25	180	184	21,942
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	6.0000	2025/10/25	550	776	92,308
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	4.5000	2041/04/25	476	884	105,136
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	4.0000	2060/04/25	80	168	19,998
FRANCE O.A.T.	5.7500	2032/10/25	528	931	110,698
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	2.5000	2030/05/25	495	637	75,696
FRANCE O.A.T.	8.5000	2019/10/25	163	166	19,754
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	2.2500	2024/05/25	405	461	54,879
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	3.2500	2045/05/25	360	594	70,669
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	4.0000	2055/04/25	302	608	72,251
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2022/05/25	598	610	72,518
FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2021/04/25	170	183	21,758
FRANCE O.A.T.	4.7500	2035/04/25	365	627	74,553
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	0.5000	2026/05/25	110	117	13,932
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.7500	2028/05/25	145	158	18,824
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2022/02/25	640	651	77,352
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	2.2500	2022/10/25	270	296	35,196
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	0.5000	2025/05/25	100	106	12,611
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	1.7500	2023/05/25	134	146	17,425
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2020/05/25	95	95	11,344
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	1.0000	2027/05/25	300	332	39,532
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	2.5000	2020/10/25	360	373	44,437
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2025/03/25	500	514	61,191
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	2.0000	2048/05/25	35	47	5,638
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2024/03/25	600	617	73,363
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT	0.0000	2021/02/25	100	101	12,011
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	4.0000	2038/10/25	385	652	77,529
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT	2.7500	2027/10/25	496	625	74,348

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				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
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.0000	2023/08/15	175	195	23,178
DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK	6.2500	2030/01/04	135	232	27,657
DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK	4.7500	2034/07/04	92	162	19,343
DEUTSCHLAND REP	6.2500	2024/01/04	320	421	50,064
DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK	5.6250	2028/01/04	40	61	7,315
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	170	253	30,076
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2020/03/13	20	20	2,386
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	57	76	9,056
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	77	82	9,780
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2020/06/12	60	60	7,171
DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK	5.5000	2031/01/04	85	144	17,161
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2019/09/13	210	210	24,963
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE	0.2500	2029/02/15	387	415	49,358
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.7500	2024/02/15	60	67	7,961
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2019/12/13	260	260	30,958
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	367	609	72,437
DEUTSCHLAND REP	6.5000	2027/07/04	281	443	52,682
DEUTSCHLAND REP	3.2500	2042/07/04	48	84	10,068
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	315	511	60,731
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	145	273	32,513
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.0000	2024/08/15	240	261	31,089
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	224	247	29,439
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	3.2500	2021/07/04	380	409	48,666
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.5000	2022/09/04	171	183	21,793
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.5000	2023/02/15	471	510	60,609
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.5000	2023/05/15	21	22	2,715
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	3.0000	2020/07/04	540	558	66,344
BUNDES OBLIGATION	0.2500	2019/10/11	280	280	33,315
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	550	576	68,513
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	196	342	40,644
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1.5000	2024/05/15	102	113	13,459
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	120	129	15,400
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2023/10/13	280	289	34,396
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	2.0000	2022/01/04	115	122	14,604
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	152	309	36,742
<b>(ユーロ・・・スペイン)</b>					
SPANISH GOV'T	6.0000	2029/01/31	275	425	50,559
SPANISH GOV'T	5.7500	2032/07/30	364	607	72,161
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.7000	2048/10/31	28	37	4,500
SPANISH GOV'T	4.8000	2024/01/31	285	350	41,676
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.8500	2022/01/31	505	585	69,533
SPANISH GOV'T	4.6500	2025/07/30	356	459	54,558
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.4000	2023/01/31	430	517	61,509
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.5000	2021/04/30	262	289	34,390
SPAIN GOVERNMENT BOND	3.8000	2024/04/30	263	314	37,327



銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ・・・スペイン)	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.7000	2041/07/30	175	303	36,054
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.5000	2027/04/30	305	339	40,318
SPAIN GOVERNMENT BOND	3.4500	2066/07/30	100	161	19,214
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.4000	2023/10/31	290	348	41,421
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.2000	2037/01/31	225	352	41,850
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.0500	2021/10/31	50	50	6,009
SPAIN GOVERNMENT BOND	0.0500	2021/01/31	120	120	14,373
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.9000	2026/07/30	270	382	45,438
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.7500	2024/10/31	40	46	5,501
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.3500	2033/07/30	65	80	9,548
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.1500	2028/10/31	540	786	93,408
SPAIN GOVERNMENT BOND	2.1500	2025/10/31	270	308	36,654
SPAIN GOVERNMENT BOND	4.9000	2040/07/30	199	349	41,524
SPAIN GOVERNMENT BOND	5.1500	2044/10/31	284	536	63,708
SPAIN GOVERNMENT BOND	1.9500	2030/07/30	60	70	8,355
(ユーロ・・・イタリア)					
BUONI POLIENNALI DEL	9.0000	2023/11/01	177	238	28,338
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.8500	2049/09/01	228	285	33,950
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.5000	2025/11/15	130	141	16,784
BUONI POLIENNALI DEL	7.2500	2026/11/01	374	530	63,018
BUONI POLIENNALI DEL	6.0000	2031/05/01	227	328	39,046
BUONI POLIENNALI DEL	5.0000	2034/08/01	658	910	108,126
BTPS	5.2500	2029/11/01	645	866	102,966
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.5000	2026/03/01	455	552	65,706
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2044/09/01	356	501	59,554
BUONI POLIENNALI DEL	5.7500	2033/02/01	330	478	56,881
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2040/09/01	175	248	29,522
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.5000	2022/11/01	365	423	50,343
BUONI POLIENNALI DEL	6.5000	2027/11/01	418	586	69,667
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.3500	2022/04/15	240	246	29,306
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2022/03/01	540	605	71,963
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.5000	2023/05/01	310	354	42,170
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2028/09/01	142	183	21,755
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.5000	2030/03/01	200	235	28,022
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.8000	2028/12/01	200	223	26,563
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2021/09/01	215	235	27,979
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.7500	2024/07/01	135	140	16,747
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.3000	2021/10/15	105	109	13,061
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.4500	2048/03/01	190	225	26,781
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	2.1000	2026/07/15	100	106	12,616
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.7500	2021/08/01	245	262	31,209
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2039/08/01	258	366	43,527
BTPS	3.7500	2021/03/01	398	421	50,123
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.0000	2022/07/15	70	71	8,472
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.5000	2022/09/01	273	315	37,462

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	
				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 BUONI POLIENNALI DEL TESORO	1.2000	2022/04/01	110	112	13,382
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.7500	2023/08/01	62	72	8,563
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	5.0000	2025/03/01	456	555	66,025
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.7500	2024/09/01	370	422	50,251
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	3.7500	2021/05/01	150	159	18,976
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4.5000	2024/03/01	631	736	87,526
<b>(ユーロ・・・フィンランド)</b>					
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2023/09/15	69	70	8,427
FINLAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2023/04/15	140	151	17,991
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5000	2027/09/15	30	32	3,815
FINNISH GOV'T	4.0000	2025/07/04	46	58	6,972
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5000	2028/09/15	55	59	7,017
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.5000	2026/04/15	150	159	19,000
FINLAND GOVERNMENT BOND	1.1250	2034/04/15	90	104	12,427
FINLAND GOVERNMENT BOND	2.6250	2042/07/04	33	51	6,066
FINLAND GOVERNMENT BOND	0.7500	2031/04/15	30	33	3,921
FINLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/07/04	10	12	1,518
FINLAND GOVERNMENT BOND	1.6250	2022/09/15	40	42	5,101
FINLAND GOVERNMENT BOND	3.5000	2021/04/15	25	26	3,183
<b>(ユーロ・・・オーストリア)</b>					
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.6500	2024/10/21	113	126	15,017
REP OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	133	224	26,707
REP OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	240	369	43,903
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	3.1500	2044/06/20	44	73	8,742
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.5000	2047/02/20	35	44	5,312
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2022/09/20	70	71	8,497
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	3.4000	2022/11/22	60	68	8,100
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.0000	2023/07/15	83	85	10,119
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	3.8000	2062/01/26	58	128	15,220
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	2.1000	2117/09/20	48	83	9,917
REP OF AUSTRIA	3.9000	2020/07/15	65	67	8,052
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	0.5000	2029/02/20	10	10	1,272
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	1.7500	2023/10/20	92	101	12,055
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	3.6500	2022/04/20	70	78	9,308
REP OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	150	204	24,260
REPUBLIC OF AUSTRIA GOVERNMENT BOND	2.4000	2034/05/23	145	194	23,108
小 計	-	-	40,886	52,691	6,260,840
合 計	-	-	-	-	16,451,203

(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) 額面、評価額の単位未満は切捨て。

## ◇資産状況

## ■投資信託財産の構成

2019年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 16,451,203	% 97.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	371,723	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	16,822,926	100.0

- (注1) 当期末における外貨建資産(16,609,678千円)の投資信託財産総額(16,822,926千円)に対する比率は、98.7%です。  
(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=107.17円、1カナダ・ドル=81.07円、1オーストラリア・ドル=72.98円、1シンガポール・ドル=77.90円、1英国・ポンド=130.10円、1デンマーク・クローネ=15.91円、1ノルウェー・クローネ=12.07円、1スウェーデン・クローナ=11.09円、1メキシコ・ペソ=5.58円、1マレーシア・リンギット=25.81円、1南アフリカ・ランド=7.32円、1ポーランド・ズロチ=27.58円、1ユーロ=118.82円です。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	17,052,051,570円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	86,040,876
公 社 債(評価額)	16,451,203,663
未 収 入 金	384,615,324
未 収 利 息	106,605,012
前 払 費 用	23,586,695
(B) 負 債	432,395,339
未 払 金	418,440,044
未 払 解 約 金	13,955,295
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	16,619,656,231
元 本	13,767,117,428
次 期 繰 越 損 益 金	2,852,538,803
(D) 受 益 権 総 口 数	13,767,117,428口
1万口当り基準価額(C/D)	12,072円

## &lt;注記事項&gt;

期元本額	8,188,995,576円
期中追加設定元本額	16,503,867,690円
期中一部解約元本額	10,925,745,838円

## 期末における元本の内訳

JDFインデックス・ファンド外国債券V A(適格機関投資家専用)	2,550,713,384円
JDFインデックス・ファンド外国債券I(適格機関投資家専用)	395,208,820円
iシェアーズ 先進国債券インデックス・ファンド	298,914,484円
ブラックロック・インデックス投資戦略ファンド	2,160,936,148円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,354,826,407円
ブラックロックLifePathファンド2055	3,441,182円
ブラックロックLifePathファンド2045	2,249,943円
ブラックロックLifePathファンド2035	1,671,682円
ブラックロック・つみたて・グローバルバランスファンド	359,033,187円
ブラックロックLifePathファンド2030	1,184,968円
ブラックロックLifePathファンド2040	3,641,219円
ブラックロックLifePathファンド2050	1,053,007円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(年1回決算型/適格機関投資家限定)	1,634,167,127円
ブラックロックLifePathファンド2025	75,870円
合計	13,767,117,428円

## ■損益の状況

自2018年8月3日 至2019年8月2日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	392,835,844円
受 取 利 息	392,856,733
支 払 利 息	△ 20,889
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 69,670,584
売 買 損 益	1,009,685,825
売 買 損	△1,079,356,409
(C) そ の 他 費 用	△ 3,441,451
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	319,723,809
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,558,188,672
(F) 解 約 差 損 益 金	△2,179,113,263
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,153,739,585
(H) 計 (D+E+F+G)	2,852,538,803
次 期 繰 越 損 益 金(H)	2,852,538,803

- (注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。  
(注3) 損益の状況の中で解約差損益金とは中途解約の際、解約代金と元本の差額をいいます。