



日立外国債券インデックスファンド

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	ベンチマークの動きに連動する投資成果を追求することにより、中長期的に投資信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	日立外国債券インデックスファンド	次の日立外国債券インデックスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	日立外国債券インデックスマザーファンド	国際機関債およびわが国を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	日立外国債券インデックスファンド	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	日立外国債券インデックスマザーファンド	株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	期中には分配を行わず、投資信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。	

運用報告書(全体版)

第14期

(決算日 2015年5月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、日立外国債券インデックスファンドは、このたび、第14期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

◎ 日立投資顧問株式会社

東京都千代田区神田練塀町3番地

〈運用報告書(全体版)に関するお問い合わせ先〉

企画総務グループ TEL : (03) 4554-5100

(受付時間 : 9 : 00 ~ 17 : 00 土、日、祝日除く)

ホームページアドレス <http://www.hitachi-im.co.jp/>

日立外国債券インデックスファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		シティ世界国債インデックス (除く日本/円ベース(為替ヘッジなし))		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率			
10期(2011年5月16日)	12,906	△ 4.1	13,547	△ 3.8	98.3	—	百万円 9,044
11期(2012年5月15日)	13,186	2.2	13,894	2.6	98.5	—	9,811
12期(2013年5月15日)	17,583	33.3	18,578	33.7	98.5	—	12,251
13期(2014年5月15日)	18,444	4.9	19,551	5.2	98.6	—	13,633
14期(2015年5月15日)	20,649	12.0	21,949	12.3	98.7	—	15,554

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注3) シティ世界国債インデックス(除く日本/円ベース(為替ヘッジなし))は、シティ世界国債インデックスを基に、日立投資顧問が計算したものでファンド設定日前日である2001年12月4日を10,000としています。シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数です。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		シティ世界国債インデックス (除く日本/円ベース(為替ヘッジなし))		債券組入 比率	債券先物 比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2014年 5月15日	18,444	—	19,551	—	98.6	—
5月末	18,405	△ 0.2	19,505	△ 0.2	98.5	—
6月末	18,466	0.1	19,574	0.1	98.5	—
7月末	18,656	1.1	19,771	1.1	98.5	—
8月末	18,937	2.7	20,084	2.7	98.6	—
9月末	19,465	5.5	20,651	5.6	98.6	—
10月末	19,502	5.7	20,696	5.9	98.6	—
11月末	21,145	14.6	22,448	14.8	98.7	—
12月末	21,368	15.9	22,694	16.1	98.7	—
2015年 1月末	20,739	12.4	22,022	12.6	98.7	—
2月末	20,780	12.7	22,081	12.9	98.7	—
3月末	20,704	12.3	21,991	12.5	98.8	—
4月末	20,734	12.4	21,987	12.5	99.7	—
(期末) 2015年 5月15日	20,649	12.0	21,949	12.3	98.7	—

(注1) 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、各組入比率は実質比率を記載しております。

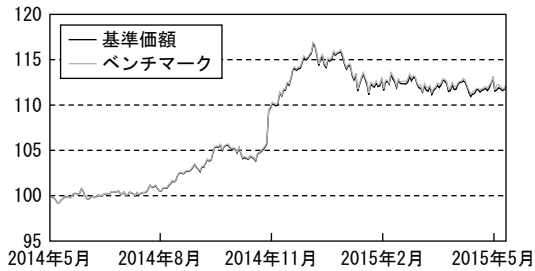
(注3) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注4) シティ世界国債インデックス(除く日本/円ベース(為替ヘッジなし))は、シティ世界国債インデックスを基に、日立投資顧問が計算したものでファンド設定日前日である2001年12月4日を10,000としています。シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数です。

《当期中の運用経過》

【期中の基準価額等の推移】

基準価額とベンチマークの推移



*期首を100として指数化

【基準価額の変動要因】

〈上昇要因〉

グローバルでの金融緩和政策を背景とした金利低下の流れがプラスに影響しました。

〈下落要因〉

ECB量的緩和策やギリシャ懸念を背景としたユーロ安(円高)がマイナスに影響しました。加えて、直近の欧州主導の金利急騰局面はマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2014年5月15日	2014年12月8日	2014年5月21日	2015年5月15日
基準価額	18,444円	21,534円	18,300円	20,649円

【当ファンドのベンチマークとの差異】

当ファンドの基準価額は前期末の18,444円からシティ世界国債インデックス(除く日本)とほぼリンクして動き、20,649円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は+12.0%となり、ベンチマーク騰落率+12.3%にほぼ追随したパフォーマンスとなりました。当ファンドから信託報酬の支払いが行われたことがベンチマークを下回る主な要因となりました。

【投資環境】

当期、主要国金利は低下しました。米国、欧州とも長期金利が大きく低下しプラス影響となりました。また、為替市場では円安ドル高が進行したものの、対ユーロでは円高が進行したことから為替効果は小幅のプラスに留まりました。

米国金利

米10年国債利回りは、期初の2.5%台から期末の2.2%台まで約0.3%低下しました。直近、欧州主導での金利低下基調反転が見られるまでは、米10年国債利回りは、1.9%台まで低下しました。米国は景気が回復基調にあり、金利引き上げが視野に入っている一方で、原油価格下落による期待インフレ率の低下などもあり日本や欧州をはじめ、世界的に多くの国で金融緩和政策がとられ、金利が低下しました。また地政学的リスクの高まりもあり、相対的に利回

りの高い米国債が買われたことなどが米長期金利を押し下げる材料となりました。

ユーロ金利

ユーロ圏のインフレ率低下に歯止めがかからず、ECBは2014年6月にはマイナス金利の導入を決定し、2015年1月には量的緩和の実施を決定しました。その結果、ユーロ圏の国債利回りは各国とも大幅に低下しました。ドイツでは7年国債利回りまでが一時的にマイナス圏に突入し、イールドカーブのフラット化が進行しました。周縁国の利回りはドイツを上回る低下幅を示し、利回り格差の縮小が続きました。直近では、それまでの金利低下基調に調整が入り、金利が急騰する局面が見られ不安定な相場となっています。

〈外国為替市場〉

外国為替市場は、米国経済の良好な景況感等を背景にドルは主要通貨に対し上昇しました。2014年10月末に米FRBが量的緩和第3段(QE3)を終了し、利上げへの準備段階に入る一方、日銀やECB等世界の中央銀行が緩和姿勢をとった結果、ドルの独歩高が期末にかけて継続しました。

円は対ドルで大幅に下落しました。2014年10月末に日銀が追加の量的緩和に踏み切ったことなどから、一時121円台後半を付けました。

一方、円は対ユーロで上昇しました。期初から10月末にかけては、欧州の景気減速懸念などを背景に円高ユーロ安が進行しました。2014年10月末の日銀による追加の量的緩和により、円安ユーロ高へと転じる場面もありましたが、2015年1月以降は、ECBが量的緩和策の実施を決定したことなどから、再び円高ユーロ安が進行し、期末にかけて円高基調が継続しました。

【当ファンドのポートフォリオ】

〈当ファンド〉

日立外国債券インデックスマザーファンドへの投資を高位に保つ運用を行いました。

〈日立外国債券インデックスマザーファンド〉

海外の国債を主要投資対象とします。具体的には、シティ世界国債インデックス(除く日本)をベンチマークとし、ベンチマークに連動する収益率の実現を目指すインデックス運用を行いました。

【今後の運用方針】

パッシブ運用につき、投資するマザーファンドにおいては、ベンチマークに連動すべく適宜リバランスを実施してまいります。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2014. 5. 16～2015. 5. 15)		
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	43円	0.216%	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19,908円です。 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口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)	(17)	(0.087)	
(販 売 会 社)	(15)	(0.075)	
(受 託 会 社)	(11)	(0.054)	
(b) そ の 他 費 用	6	0.028	その他費用＝〔期中のその他費用〕÷〔期中の平均受益権口数〕 保管費用は、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
(保 管 費 用)	(6)	(0.028)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	49	0.244	

(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) 「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。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2014年5月16日から2015年5月15日まで)

ファンド名称	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日立外国債券 インデックス マザーファンド	千口 609,748	千円 1,291,400	千口 495,710	千円 1,085,650

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2014年5月16日から2015年5月15日まで)

公社債(日立外国債券インデックスマザーファンド)における主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
2.5% US TREASURY N/B(アメリカ)	315,319	2.5% US TREASURY N/B(アメリカ)	167,276
2.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	174,258	4.25% US TREASURY N/B(アメリカ)	122,332
US TREASURY N/B(アメリカ)	167,945	0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	119,061
3.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	126,038	0.50% US TREASURY N/B(アメリカ)	112,087
3.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	124,808	2.00% UK TREASURY(イギリス)	108,358
0.5% US TREASURY N/B(アメリカ)	118,079	2.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	107,038
3.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	115,444	0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	102,662
3.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	112,552	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	101,776
0.5% US TREASURY N/B(アメリカ)	106,156	0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	101,536
0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	102,825	3.00% FRANCE GOV'T(ユーロ・フランス)	101,477

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等

(2014年5月16日から2015年5月15日まで)

期中の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(2015年5月15日現在)
親投資信託残高

項 目	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数		評 価 額	
	千口		千円	
日立外国債券インデックスマザーファンド	6,794,865		6,908,903	
			15,536,051	

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

■投資信託財産の構成(2015年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日立外国債券インデックスマザーファンド	15,536,051	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	49,091	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	15,585,142	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 日立外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(32,375,049千円)の投資信託財産総額(32,400,521千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、5月15日における邦貨換算レートは1米ドル=119.39円、1カナダドル=99.54円、1メキシコペソ=7.91円、1ユーロ=136.14円、1英ポンド=188.25円、1スイスフラン=130.71円、1スウェーデンクローナ=14.49円、1ノルウェークローネ=16.19円、1デンマーククローネ=18.23円、1ポーランドズロチ=33.44円、1オーストラリアドル=96.18円、1シンガポールドル=90.32円、1マレーシアリンギット=33.40円、1南アフリカランド=10.12円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2015年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	15,585,142,331円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	26,690,714
日立外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	15,536,051,610
未 収 入 金	22,400,000
未 収 利 息	7
(B) 負 債	30,609,279
未 払 解 約 金	13,574,737
未 払 信 託 報 酬	17,034,542
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	15,554,533,052
元 本	7,532,663,726
次 期 繰 越 損 益 金	8,021,869,326
(D) 受 益 権 総 口 数	7,532,663,726口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,649円

(注1) 当ファンドの期首元本額は7,391,835,201円、期中追加設定元本額は1,421,346,945円、期中一部解約元本額は1,280,518,420円です。

(注2) 1口当たり純資産額は2,0649円です。

■損益の状況

当期(自2014年5月16日 至2015年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,954円
受 取 利 息	3,954
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,514,211,769
売 買 益	1,720,039,642
売 買 損	△ 205,827,873
(C) 信 託 報 酬 等	△ 32,646,593
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,481,569,130
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,390,089,785
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,150,210,411
(配 当 等 相 当 額)	(3,668,858,713)
(売 買 損 益 相 当 額)	(481,351,698)
(G) 計 (D+E+F)	8,021,869,326
次 期 繰 越 損 益 金(G)	8,021,869,326
追 加 信 託 差 損 益 金	4,150,210,411
(配 当 等 相 当 額)	(3,668,858,713)
(売 買 損 益 相 当 額)	(481,351,698)
分 配 準 備 積 立 金	3,871,658,915

(注1) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

<お知らせ>

「投資信託及び投資法人に関する法律」ならびに一般社団法人投資信託協会規則の改正に伴い、所要の約款変更を行いました。(適用日：2014年12月1日)

<補足情報>

日立外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の明細(2015年5月15日現在)

下記は、日立外国債券インデックスマザーファンド全体(14,398,377千口)の内容です。

公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	2015年5月15日現在							
	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 107,580	千米ドル 111,467	千円 13,308,089	% 41.1	% -	% 15.8	% 16.3	% 9.0
カ ナ ダ	千カナダドル 6,730	千カナダドル 7,559	752,509	2.3	-	1.1	0.6	0.7
メ キ シ コ	千メキシコペソ 38,470	千メキシコペソ 42,030	332,459	1.0	-	0.6	0.2	0.2
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	15,190	17,937	2,442,073	7.5	-	4.7	1.9	0.9
イ タ リ ア	19,700	23,442	3,191,425	9.9	-	5.8	3.0	1.1
フ ラ ン ス	19,030	22,680	3,087,687	9.5	-	5.9	2.6	1.0
オ ラ ン ダ	5,110	6,059	824,947	2.5	-	1.5	0.6	0.4
ス ペ イ ン	10,920	12,893	1,755,253	5.4	-	3.0	1.6	0.8
ベルギー	4,910	6,124	833,762	2.6	-	1.8	0.6	0.2
オーストリア	3,070	3,776	514,137	1.6	-	1.0	0.4	0.2
フィンランド	1,240	1,423	193,808	0.6	-	0.4	0.2	0.0
アイルランド	1,580	1,882	256,343	0.8	-	0.4	0.4	-
イ ギ リ ス	千英ポンド 12,260	千英ポンド 14,441	2,718,617	8.4	-	6.1	1.9	0.4
ス イ ス	千スイスフラン 630	千スイスフラン 750	98,072	0.3	-	0.1	0.2	-
スウェーデン	千スウェーデン クローナ 8,980	千スウェーデン クローナ 10,714	155,255	0.5	-	0.3	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 5,730	千ノルウェークローネ 6,156	99,681	0.3	-	0.2	0.1	-
デンマーク	千デンマーククローネ 9,370	千デンマーククローネ 12,064	219,939	0.7	-	0.5	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 5,010	千ポーランドズロチ 5,492	183,680	0.6	-	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 5,490	千オーストラリアドル 5,990	576,134	1.8	-	1.0	0.5	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 1,210	千シンガポールドル 1,260	113,868	0.4	-	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシア リンギット 5,030	千マレーシア リンギット 5,049	168,657	0.5	-	0.2	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 17,940	千南アフリカランド 17,003	172,072	0.5	-	0.4	0.1	-
合 計	-	-	31,998,479	98.8	-	51.3	32.1	15.5

(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、このファンドが組み入れている親投資信託の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り捨て。

(注4) -印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

外国(外貨建)公社債銘柄別

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千ドル	千ドル	千円	
0.375% US TREASURY N/B	国債証券	0.375	720	719	85,893	2016/10/31
0.5% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	1,000	1,001	119,548	2016/ 9/30
0.5% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	900	900	107,543	2016/11/30
0.5% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	410	408	48,777	2017/ 7/31
0.50% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	600	601	71,768	2016/ 6/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	850	852	101,798	2016/ 7/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	750	752	89,808	2016/10/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	720	721	86,182	2016/11/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	720	721	86,175	2016/12/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	560	561	67,030	2016/12/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	500	500	59,811	2017/ 2/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,070	1,070	127,817	2017/ 5/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	820	818	97,739	2017/ 8/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	610	608	72,651	2017/ 9/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	770	767	91,578	2017/11/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	280	277	33,141	2018/ 4/30
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	740	743	88,735	2017/ 1/15
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	750	753	89,906	2017/ 3/15
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	730	731	87,372	2017/ 6/30
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	390	389	46,554	2017/10/31
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	690	689	82,269	2017/12/31
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	790	787	94,038	2018/ 2/28
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	460	458	54,704	2018/ 3/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	490	493	58,871	2016/ 9/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	800	805	96,131	2016/11/30
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	810	815	97,370	2016/12/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	720	724	86,518	2017/ 1/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	80	80	9,613	2017/ 2/28
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	420	422	50,453	2017/ 4/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	560	563	67,276	2017/ 4/30
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	60	60	7,205	2017/ 5/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	590	593	70,814	2017/ 6/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	550	552	65,992	2017/ 7/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	720	722	86,242	2017/10/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	270	270	32,323	2017/11/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	450	450	53,805	2018/ 1/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	340	333	39,799	2019/ 7/31
1% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	690	694	82,913	2017/ 9/15
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	710	715	85,429	2016/ 8/31
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	390	393	46,947	2016/ 9/30
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	810	816	97,521	2016/10/31
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	800	807	96,355	2017/ 3/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	600	602	71,936	2018/ 2/15
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	640	640	76,511	2018/ 5/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	300	295	35,257	2019/ 8/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	400	393	46,938	2019/ 9/30
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	370	362	43,308	2019/11/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	430	427	50,992	2019/ 5/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	450	441	52,734	2020/ 3/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	660	647	77,283	2020/ 4/30

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千ドル	千ドル	千円	
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	670	672	80,291	2018/11/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	510	511	61,026	2019/ 1/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	330	329	39,377	2019/ 4/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	330	327	39,127	2019/10/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	200	197	23,622	2020/ 1/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	690	681	81,413	2020/ 2/29
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	707	84,526	2018/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	790	797	95,231	2018/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	460	463	55,374	2018/11/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	510	513	61,321	2018/12/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	530	532	63,607	2019/ 2/28
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	720	716	85,551	2020/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	630	624	74,598	2020/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	810	804	96,093	2020/ 3/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	520	527	62,936	2016/ 7/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	620	629	75,097	2018/ 8/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	500	504	60,245	2019/ 3/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	610	611	73,055	2019/11/30
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	700	705	84,212	2019/ 5/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	710	719	85,879	2016/ 6/30
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	710	718	85,760	2018/12/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	690	697	83,254	2019/ 1/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	340	343	40,998	2019/ 2/28
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	330	331	39,527	2019/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	510	517	61,745	2019/ 3/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	510	517	61,726	2019/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	480	485	57,978	2019/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	667	79,665	2019/ 7/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	550	555	66,367	2019/ 8/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	500	503	60,124	2019/12/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	890	868	103,667	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	900	875	104,580	2022/11/15
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	480	490	58,556	2018/10/31
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	100	101	12,117	2019/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	720	723	86,363	2020/10/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	690	680	81,304	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,130	1,101	131,527	2023/ 5/15
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	700	718	85,838	2017/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	650	667	79,725	2017/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	540	554	66,233	2017/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	420	426	50,915	2020/ 6/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	530	529	63,187	2021/11/30
2.0% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,200	1,196	142,842	2023/ 2/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	630	643	76,778	2020/ 7/31
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	560	570	68,101	2020/ 9/30
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	730	87,162	2021/ 2/28
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	520	525	62,771	2021/ 5/31
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	875	104,575	2021/11/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	780	783	93,597	2022/ 2/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	680	697	83,284	2020/ 8/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	570	582	69,498	2021/ 1/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	510	518	61,940	2021/ 6/30

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	995	118,903	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	820	830	99,200	2021/12/31
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	520	532	63,571	2021/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	670	694	82,965	2017/11/30
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	270	280	33,502	2018/ 7/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	610	632	75,570	2017/ 7/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	380	396	47,306	2018/ 5/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	570	594	70,976	2018/ 6/30
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	480	497	59,362	2020/12/31
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	120	124	14,895	2017/ 6/30
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,350	1,384	165,281	2024/ 5/15
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	360	320	38,312	2045/ 2/15
2.50% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,010	1,041	124,286	2023/ 8/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	220	230	27,533	2018/ 1/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	820	862	102,940	2020/ 8/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,320	1,385	165,400	2020/11/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	670	693	82,834	2016/11/30
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	530	553	66,049	2017/ 5/31
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	300	315	37,635	2017/12/31
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	220	231	27,648	2018/ 2/28
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,090	1,141	136,245	2024/ 2/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	290	273	32,624	2042/ 8/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	660	621	74,174	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	410	433	51,718	2019/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,210	1,269	151,572	2023/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	390	412	49,192	2018/ 3/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	720	695	83,019	2043/ 5/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	460	475	56,760	2016/ 8/31
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	620	641	76,647	2016/ 9/30
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	240	250	29,929	2017/ 2/28
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	170	168	20,117	2042/ 5/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	700	693	82,750	2044/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	670	696	83,140	2016/10/31
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	600	626	74,846	2017/ 1/31
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	580	608	72,697	2017/ 4/30
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	730	782	93,412	2019/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	930	1,000	119,455	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	274	32,796	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	375	44,854	2042/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	910	923	110,223	2044/ 8/15
3.250% US TREASURY N/B	国債証券	3.25	370	382	45,620	2016/ 6/30
3.250% US TREASURY N/B	国債証券	3.25	500	517	61,784	2016/ 7/31
3.250% US TREASURY N/B	国債証券	3.25	500	522	62,371	2016/12/31
3.250% US TREASURY N/B	国債証券	3.25	580	609	72,751	2017/ 3/31
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	860	933	111,402	2019/11/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	900	956	114,149	2044/ 5/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	290	310	37,127	2018/ 2/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	840	918	109,713	2020/ 5/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	100	108	12,983	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	580	634	75,738	2019/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,230	1,351	161,362	2020/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,150	1,269	151,586	2021/ 2/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	780	867	103,557	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	960	1,067	127,490	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	410	447	53,389	2018/11/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	60	68	8,129	2041/ 8/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	930	1,056	126,169	2043/11/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	440	478	57,136	2018/ 5/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	40	46	5,506	2040/ 8/15
4.00% US TREASURY N/B	国債証券	4.0	300	329	39,292	2018/ 8/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	490	532	63,565	2017/11/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	340	413	49,377	2039/ 5/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	170	207	24,799	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	250	309	37,006	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	770	956	114,230	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	50	62	7,457	2041/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	400	431	51,460	2017/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	37	4,520	2038/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	470	593	70,838	2039/ 8/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	330	418	49,944	2036/ 2/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	470	499	59,637	2016/11/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	330	353	42,233	2017/ 2/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	400	514	61,429	2040/ 2/15
4.75% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	490	644	76,992	2041/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	350	381	45,596	2017/ 8/15
4.875% US TREASURY N/B	国債証券	4.875	460	485	58,012	2016/ 8/15
5.00% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	130	175	20,984	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	170	223	26,653	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	157	18,831	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	260	351	42,012	2031/ 2/15
5.50% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	160	19,183	2028/ 8/15
6.00% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	140	189	22,631	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	130	182	21,731	2027/11/15
6.25% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	263	31,494	2023/ 8/15
6.25% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	150	218	26,030	2030/ 5/15
6.50% US TREASURY N/B	国債証券	6.5	90	127	15,237	2026/11/15
7.50% US TREASURY N/B	国債証券	7.5	330	364	43,550	2016/11/15
8.00% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	260	357	42,720	2021/11/15
8.125% US TREASURY N/B	国債証券	8.125	140	179	21,426	2019/ 8/15
8.75% US TREASURY N/B	国債証券	8.75	310	360	43,042	2017/ 5/15
8.75% US TREASURY N/B	国債証券	8.75	210	286	34,176	2020/ 8/15
8.875% US TREASURY N/B	国債証券	8.875	40	51	6,137	2019/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,370	1,388	165,813	2024/ 8/15
小計	—	—	—	—	13,308,089	—
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
1.00% CANADA GOV' T	国債証券	1.0	270	270	26,949	2016/ 5/ 1
1.00% CANADA GOV' T	国債証券	1.0	300	301	29,973	2016/ 8/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	180	182	18,176	2018/ 2/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	140	142	14,176	2018/ 9/ 1
1.5 % CANADA GOV' T	国債証券	1.5	160	163	16,241	2020/ 3/ 1
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	340	345	34,343	2017/ 3/ 1
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	140	142	14,192	2017/ 9/ 1
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	310	307	30,567	2023/ 6/ 1
1.75% CANADA COV' T	国債証券	1.75	100	103	10,285	2019/ 9/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
1.75% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	200	206	20,587	2019/ 3/ 1
2.00% CANADA GOV' T	国債証券	2.0	380	385	38,332	2016/ 6/ 1
2.50% CANADA GOV' T	国債証券	2.5	100	106	10,605	2024/ 6/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	290	297	29,629	2016/ 9/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	190	206	20,521	2022/ 6/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	60	64	6,409	2048/12/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	120	131	13,116	2064/12/ 1
3.25% CANADA GOV' T	国債証券	3.25	310	345	34,434	2021/ 6/ 1
3.50% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	220	245	24,450	2020/ 6/ 1
3.50% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	200	246	24,506	2045/12/ 1
3.75% CANADA GOV' T	国債証券	3.75	350	389	38,786	2019/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	330	341	33,964	2016/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	280	298	29,742	2017/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	290	377	37,534	2041/ 6/ 1
4.25% CANADA GOV' T	国債証券	4.25	170	187	18,706	2018/ 6/ 1
5.00% CANADA GOV' T	国債証券	5.0	330	477	47,547	2037/ 6/ 1
5.75% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	270	388	38,711	2029/ 6/ 1
5.75% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	270	408	40,643	2033/ 6/ 1
8.00% CANADA GOV' T	国債証券	8.0	100	164	16,367	2027/ 6/ 1
CANADA GOV' T	国債証券	1.0	330	331	33,003	2016/11/ 1
小計	—	—	—	—	752,509	—
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
4.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	4.75	2,800	2,802	22,167	2018/ 6/14
5.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.0	3,850	3,914	30,962	2017/ 6/15
6.25% MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.25	3,750	3,855	30,498	2016/ 6/16
6.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	900	935	7,400	2022/ 6/ 9
7.25% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.25	4,100	4,312	34,110	2016/12/15
7.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	3,100	3,401	26,901	2027/ 6/ 3
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	1,670	1,802	14,254	2017/12/14
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,592	20,507	2031/ 5/29
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	900	1,009	7,988	2034/11/23
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	3,400	3,837	30,351	2042/11/13
8.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	3,040	3,391	26,826	2020/ 6/11
8.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	1,550	1,764	13,955	2023/12/ 7
8.5% MEXICAN BONOS	国債証券	8.5	900	1,002	7,933	2018/12/13
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	2,980	3,543	28,026	2029/ 5/31
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,210	3,865	30,573	2038/11/18
小計	—	—	—	—	332,459	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	410	414	56,409	2018/ 4/13
0.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	290	284	38,671	2025/ 2/15
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	380	384	52,405	2017/ 4/ 7
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	160	162	22,128	2017/10/13
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	410	417	56,777	2018/ 2/23
0.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.75	370	376	51,218	2017/ 2/24
1% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	270	277	37,820	2024/ 8/15
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	330	341	46,552	2018/10/12
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	360	373	50,882	2019/ 2/22
1.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.25	370	377	51,409	2016/10/14
1.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	130	139	19,023	2024/ 5/15
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	400	430	58,616	2022/ 9/ 4
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	820	883	120,275	2023/ 2/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	420	452	61,587	2023/ 5/15
1.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	400	438	59,645	2022/ 7/ 4
1.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	210	230	31,399	2024/ 2/15
2.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	420	466	63,474	2022/ 1/ 4
2.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	360	402	54,778	2023/ 8/15
2.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	300	333	45,387	2020/ 9/ 4
2.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	370	415	56,557	2021/ 9/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	330	372	50,703	2021/ 1/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	310	393	53,606	2044/ 7/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	160	203	27,715	2046/ 8/15
3.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.0	430	493	67,133	2020/ 7/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	360	412	56,214	2020/ 1/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	380	449	61,127	2021/ 7/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	160	228	31,066	2042/ 7/ 4
3.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.5	370	423	57,600	2019/ 7/ 4
3.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.75	530	564	76,829	2017/ 1/ 4
3.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.75	430	489	66,589	2019/ 1/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	510	534	72,750	2016/ 7/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	440	488	66,436	2018/ 1/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	370	559	76,217	2037/ 1/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	400	437	59,596	2017/ 7/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	580	658	89,699	2018/ 7/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	260	415	56,517	2039/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	210	308	42,006	2028/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	330	528	71,890	2034/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	350	604	82,356	2040/ 7/ 4
5.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	290	473	64,444	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	270	422	57,456	2028/ 1/ 4
6.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	160	236	32,261	2024/ 1/ 4
6.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	170	291	39,719	2030/ 1/ 4
6.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	210	346	47,109	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.75	170	171	23,412	2018/ 1/15
1.05% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.05	390	395	53,811	2019/12/ 1
1.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	420	434	59,140	2019/ 8/ 1
1.65% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	90	80	10,961	2032/ 3/ 1
2.15% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	190	199	27,196	2021/12/15
2.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	360	367	50,078	2016/ 5/15
2.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	120	125	17,145	2024/12/ 1
2.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	510	547	74,534	2019/ 5/ 1
2.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.75	240	249	33,967	2016/11/15
3.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	180	189	25,803	2046/ 9/ 1
3.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	170	193	26,293	2030/ 3/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	200	215	29,387	2017/11/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	330	360	49,135	2018/ 6/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	400	442	60,244	2018/12/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	580	605	82,474	2016/ 8/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	530	609	82,941	2021/ 3/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	724	98,642	2021/ 8/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	430	497	67,666	2024/ 9/ 1
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	530	564	76,916	2017/ 2/ 1
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	320	370	50,395	2020/ 9/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	380	450	61,371	2037/ 2/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	270	306	41,760	2019/ 2/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	552	75,201	2019/ 9/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	557	75,920	2020/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	490	544	74,193	2018/ 2/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	550	621	84,588	2018/ 8/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	490	562	76,574	2019/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	460	539	73,445	2020/ 2/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	420	509	69,306	2023/ 5/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	470	571	77,806	2024/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	360	445	60,640	2026/ 3/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	380	403	54,945	2016/ 9/15
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	360	392	53,387	2017/ 5/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	130	142	19,335	2017/ 6/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	470	568	77,429	2021/ 9/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	480	591	80,475	2023/ 8/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	170	215	29,381	2028/ 9/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	320	431	58,790	2044/ 9/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	460	567	77,322	2022/ 3/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	440	559	76,122	2025/ 3/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	420	564	76,888	2034/ 8/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	350	476	64,893	2039/ 8/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	380	516	70,269	2040/ 9/ 1
5.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	580	644	87,686	2017/ 8/ 1
5.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	570	764	104,069	2029/11/ 1
5.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	410	522	71,128	2022/ 9/ 1
5.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	390	497	67,727	2022/11/ 1
5.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	350	506	68,976	2033/ 2/ 1
6.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	570	832	113,388	2031/ 5/ 1
6.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	510	744	101,383	2027/11/ 1
7.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	220	334	45,504	2026/11/ 1
9.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	156	21,361	2023/11/ 1
(ユーロ…フランス)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0% FRANCE GOV' T	国債証券	—	380	374	51,045	2020/ 5/25
0.5% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	180	182	24,858	2019/11/25
0.5% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	430	409	55,741	2025/ 5/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	410	420	57,179	2017/ 7/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	530	546	74,369	2018/ 5/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	490	506	68,936	2018/11/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	440	455	62,022	2019/ 5/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	390	403	54,873	2017/ 2/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	510	550	74,944	2023/ 5/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	470	505	68,771	2024/11/25
2.25% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	520	581	79,202	2022/10/25
2.25% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	570	638	86,927	2024/ 5/25
2.5% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	520	600	81,758	2030/ 5/25
2.50% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	570	588	80,051	2016/ 7/25
2.50% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	720	805	109,646	2020/10/25
2.75% FRANCE GOV' T	国債証券	2.75	560	659	89,724	2027/10/25
3.00% FRANCE GOV' T	国債証券	3.0	650	759	103,339	2022/ 4/25
3.25% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	560	659	89,778	2021/10/25
3.25% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	90	118	16,145	2045/ 5/25

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
3.50% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	700	812	110,640	2020/ 4/25
3.50% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	600	751	102,366	2026/ 4/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	700	752	102,483	2017/ 4/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	570	660	89,922	2019/10/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	720	863	117,526	2021/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	610	682	92,894	2018/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	460	667	90,805	2038/10/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	310	486	66,187	2055/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	240	380	51,856	2060/ 4/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	400	442	60,228	2017/10/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	550	629	85,726	2018/10/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	650	756	102,950	2019/ 4/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	710	911	124,110	2023/10/25
4.50% FRANCE GOV' T	国債証券	4.5	340	534	72,801	2041/ 4/25
4.75% FRANCE GOV' T	国債証券	4.75	410	633	86,221	2035/ 4/25
5.00% FRANCE GOV' T	国債証券	5.0	610	655	89,215	2016/10/25
5.50% FRANCE GOV' T	国債証券	5.5	510	782	106,535	2029/ 4/25
5.75% FRANCE GOV' T	国債証券	5.75	480	799	108,907	2032/10/25
6.00% FRANCE GOV' T	国債証券	6.0	220	329	44,899	2025/10/25
8.50% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	80	109	14,904	2019/10/25
8.50% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	170	273	37,185	2023/ 4/25
(ユーロ…オランダ)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.50% NETHERLANDS GOV' TT	国債証券	0.5	270	273	37,209	2017/ 4/15
1.25% NETHERLANDS GOVT	国債証券	1.25	240	248	33,830	2018/ 1/15
1.25% NETHERLANDS GOVT	国債証券	1.25	200	208	28,428	2019/ 1/15
1.75% NETHERLANDS GOVT	国債証券	1.75	330	358	48,834	2023/ 7/15
2.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.0	70	77	10,566	2024/ 7/15
2.25% NETHERLANDS GOVT	国債証券	2.25	370	414	56,471	2022/ 7/15
2.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	2.5	280	292	39,819	2017/ 1/15
2.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	2.5	270	323	43,977	2033/ 1/15
2.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.75	90	117	16,038	2047/ 1/15
3.25% NETHERLANDS GOVT	国債証券	3.25	280	329	44,858	2021/ 7/15
3.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	3.5	320	373	50,888	2020/ 7/15
3.75% NETHERLANDS GOVT	国債証券	3.75	290	359	48,916	2023/ 1/15
3.75% NETHERLANDS GOVT	国債証券	3.75	260	396	54,007	2042/ 1/15
4.00% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.0	350	367	49,964	2016/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.0	300	337	46,012	2018/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.0	270	313	42,716	2019/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.0	280	421	57,331	2037/ 1/15
4.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.5	310	341	46,432	2017/ 7/15
5.5% NETHERLANDS GOVT	国債証券	5.5	250	382	52,083	2028/ 1/15
7.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	7.5	80	121	16,558	2023/ 1/15
(ユーロ…スペイン)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.4% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	210	216	29,489	2020/ 1/31
1.6% SPANISH GOV' T	国債証券	1.6	180	175	23,904	2025/ 4/30
1.95% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	120	112	15,371	2030/ 7/30
2.75% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	390	423	57,708	2019/ 4/30
2.75% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	310	333	45,440	2024/10/31
3.25% SPANISH GOV' T	国債証券	3.25	480	494	67,379	2016/ 4/30
3.30% SPANISH GOV' T	国債証券	3.3	380	395	53,792	2016/ 7/30
3.75% SPANISH GOV' T	国債証券	3.75	420	468	63,760	2018/10/31
3.80% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	470	500	68,080	2017/ 1/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
3.80% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	470	547	74,569	2024/ 4/30
4.00% SPANISH GOV' T	国債証券	4.0	450	520	70,813	2020/ 4/30
4.10% SPANISH GOV' T	国債証券	4.1	420	470	64,080	2018/ 7/30
4.20% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	390	476	64,828	2037/ 1/31
4.25% SPANISH GOV' T	国債証券	4.25	470	499	67,946	2016/10/31
4.30% SPANISH GOV' T	国債証券	4.3	340	394	53,763	2019/10/31
4.40% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	240	291	39,652	2023/10/31
4.50% SPANISH GOV' T	国債証券	4.5	370	412	56,174	2018/ 1/31
4.60% SPANISH GOV' T	国債証券	4.6	350	408	55,620	2019/ 7/30
4.65% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	350	438	59,704	2025/ 7/30
4.70% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	210	277	37,758	2041/ 7/30
4.80% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	340	424	57,776	2024/ 1/31
4.85% SPANISH GOV' T	国債証券	4.85	400	483	65,793	2020/10/31
4.90% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	260	351	47,855	2040/ 7/30
5.15% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	310	409	55,792	2028/10/31
5.15% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	120	170	23,209	2044/10/31
5.40% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	390	499	67,934	2023/ 1/31
5.50% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	450	503	68,504	2017/ 7/30
5.50% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	420	527	71,747	2021/ 4/30
5.75% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	400	578	78,743	2032/ 7/30
5.85% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	410	529	72,071	2022/ 1/31
5.90% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	270	373	50,813	2026/ 7/30
6.00% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	184	25,170	2029/ 1/31
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.8% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	50	49	6,674	2025/ 6/22
1.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	40	37	5,094	2031/ 6/22
1.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	290	301	41,012	2018/ 6/22
2.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	190	212	28,949	2023/ 6/22
2.60% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	260	299	40,712	2024/ 6/22
3.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	130	146	19,885	2019/ 9/28
3.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	90	111	15,237	2034/ 6/22
3.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.25	280	293	39,891	2016/ 9/28
3.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.5	230	247	33,704	2017/ 6/28
3.75% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	300	355	48,434	2020/ 9/28
3.75% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	120	173	23,649	2045/ 6/22
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	160	172	23,468	2017/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	200	223	30,389	2018/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	210	241	32,900	2019/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	310	383	52,180	2022/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	210	290	39,573	2032/ 3/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	270	335	45,649	2021/ 9/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	220	278	37,869	2022/ 9/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	270	413	56,338	2041/ 3/28
4.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	260	352	47,947	2026/ 3/28
5.0% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	330	523	71,234	2035/ 3/28
5.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	150	169	23,132	2017/ 9/28
5.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	340	512	69,829	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.15	240	249	33,918	2018/10/19
1.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	70	75	10,237	2024/10/21
1.75% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	100	108	14,775	2023/10/20
3.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	110	151	20,666	2044/ 6/20

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
3.20% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.2	250	264	36,036	2017/ 2/20
3.40% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	190	229	31,197	2022/11/22
3.50% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	320	382	52,033	2021/ 9/15
3.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	150	182	24,809	2022/ 4/20
3.80% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	84	11,514	2062/ 1/26
3.90% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.9	240	285	38,806	2020/ 7/15
4.00% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.0	120	126	17,236	2016/ 9/15
4.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	280	423	57,704	2037/ 3/15
4.30% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.3	240	264	36,012	2017/ 9/15
4.35% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.35	290	337	45,931	2019/ 3/15
4.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.65	50	56	7,660	2018/ 1/15
4.85% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	252	34,353	2026/ 3/15
6.25% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	190	302	41,241	2027/ 7/15
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.375%FINNISH GOV' T	国債証券	0.375	40	40	5,481	2020/ 9/15
1.50% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	110	117	15,975	2023/ 4/15
1.625%FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	100	107	14,673	2022/ 9/15
1.875%FINNISH GOV' T	国債証券	1.875	50	51	7,072	2017/ 4/15
2.00% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	90	99	13,575	2024/ 4/15
2.625%FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	40	51	6,956	2042/ 7/ 4
2.75% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	130	156	21,246	2028/ 7/ 4
3.375%FINNISH GOV' T	国債証券	3.375	110	127	17,295	2020/ 4/15
3.50% FINNISH GOV' T	国債証券	3.5	160	189	25,820	2021/ 4/15
3.875%FINNISH GOV' T	国債証券	3.875	150	163	22,326	2017/ 9/15
4.00% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	100	130	17,773	2025/ 7/ 4
4.375%FINNISH GOV' T	国債証券	4.375	160	188	25,611	2019/ 7/ 4
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
2.00% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	110	105	14,319	2045/ 2/18
2.40% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	90	97	13,338	2030/ 5/15
3.40% IRISH GOV' T 2024	国債証券	3.4	140	165	22,581	2024/ 3/18
3.90% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	80	97	13,219	2023/ 3/20
4.40% IRISH GOV' T	国債証券	4.4	270	316	43,058	2019/ 6/18
4.50% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	40	45	6,252	2018/10/18
4.50% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	50	59	8,131	2020/ 4/18
5.00% IRISH GOVT	国債証券	5.0	160	197	26,899	2020/10/18
5.40% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	190	259	35,390	2025/ 3/13
5.50% IRISH GOV' T	国債証券	5.5	200	226	30,846	2017/10/18
5.90% IRISH GOV' T	国債証券	5.9	250	310	42,305	2019/10/18
小計	—	—	—	—	13,099,441	—
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
1.00% UK TREASURY	国債証券	1.0	600	603	113,627	2017/ 9/ 7
1.25% UK TREASURY	国債証券	1.25	380	382	72,057	2018/ 7/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	400	407	76,798	2017/ 1/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	500	509	95,875	2019/ 7/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	510	508	95,652	2022/ 9/ 7
2% UK TREASURY	国債証券	2.0	380	389	73,323	2020/ 7/22
2.25% UK TREASURY	国債証券	2.25	550	563	106,105	2023/ 9/ 7
2.75% UK TREASURY	国債証券	2.75	250	265	49,947	2024/ 9/ 7
3.25% UK TREASURY	国債証券	3.25	250	279	52,648	2044/ 1/22
3.5% UK TREASURY	国債証券	3.5	20	23	4,392	2045/ 1/22
3.50% UK TREASURY	国債証券	3.5	300	380	71,582	2068/ 7/22
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	320	353	66,492	2019/ 9/ 7

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)						
		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	460	513	96,709	2020/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	440	496	93,390	2021/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	320	404	76,089	2052/ 7/22
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	250	261	49,208	2016/ 9/ 7
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	320	367	69,221	2022/ 3/ 7
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	280	386	72,729	2060/ 1/22
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	250	305	57,576	2027/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	380	475	89,561	2032/ 6/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	368	69,359	2036/ 3/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	240	310	58,399	2039/ 9/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	340	442	83,206	2040/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	360	483	90,967	2046/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	260	355	66,971	2049/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	497	93,580	2055/12/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	393	74,103	2019/ 3/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	360	468	88,209	2034/ 9/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	390	534	100,662	2042/12/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	380	439	82,730	2020/ 3/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	350	457	86,147	2030/12/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	320	441	83,095	2038/12/ 7
5.00% UK TREASURY	国債証券	5.0	360	401	75,624	2018/ 3/ 7
5.00% UK TREASURY	国債証券	5.0	330	417	78,566	2025/ 3/ 7
6.00% UK TREASURY	国債証券	6.0	190	273	51,580	2028/12/ 7
8.00% UK TREASURY	国債証券	8.0	30	41	7,742	2021/ 6/ 7
8.75% UK TREASURY	国債証券	8.75	200	237	44,679	2017/ 8/25
小計	—	—	—	—	2,718,617	—
(スイス)						
		%	千スイスフラン	千スイスフラン	千円	
2.00% SWITZERLAND	国債証券	2.0	60	68	8,891	2021/ 4/28
3.00% SWITZERLAND	国債証券	3.0	150	164	21,561	2018/ 1/ 8
3.00% SWITZERLAND	国債証券	3.0	170	194	25,389	2019/ 5/12
4.00% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	131	17,166	2023/ 2/11
4.00% SWITZERLAND	国債証券	4.0	70	103	13,517	2028/ 4/ 8
4.25% SWITZERLAND	国債証券	4.25	80	88	11,546	2017/ 6/ 5
小計	—	—	—	—	98,072	—
(スウェーデン)						
		%	千スウェーデン クローナ	千スウェーデン クローナ	千円	
1.50% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	400	428	6,205	2023/11/13
3.00% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.0	1,230	1,278	18,519	2016/ 7/12
3.5% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,520	1,836	26,614	2022/ 6/ 1
3.5% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	1,934	28,026	2039/ 3/30
3.75% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.75	1,120	1,222	17,712	2017/ 8/12
4.25% SWEDEN GOV' T	国債証券	4.25	1,960	2,285	33,114	2019/ 3/12
5.00% SWEDEN GOV' T	国債証券	5.0	1,370	1,729	25,062	2020/12/ 1
小計	—	—	—	—	155,255	—
(ノルウェー)						
		%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
1.75% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	840	843	13,652	2025/ 3/13
2.00% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,660	1,715	27,773	2023/ 5/24
3.75% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,400	1,590	25,757	2021/ 5/25
4.25% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.25	1,030	1,099	17,807	2017/ 5/19
4.50% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.5	800	907	14,690	2019/ 5/22
小計	—	—	—	—	99,681	—

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)						
		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
1. 50% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	640	687	12,532	2023/11/15
2. 50% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	2.5	550	573	10,461	2016/11/15
3. 00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	1,660	1,947	35,494	2021/11/15
4. 00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,260	1,392	25,388	2017/11/15
4. 00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,760	2,074	37,815	2019/11/15
4. 50% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,450	3,997	72,868	2039/11/15
7. 00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	7.0	500	791	14,422	2024/11/10
KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	550	600	10,955	2025/11/15
小計	—	—	—	—	219,939	—
(ポーランド)						
		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
0. 00% POLAND GOV' T	国債証券	—	90	86	2,893	2017/ 7/25
2. 50% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	890	902	30,193	2018/ 7/25
3. 25% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	170	176	5,908	2019/ 7/25
3. 25% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	100	102	3,442	2025/ 7/25
4. 00% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	780	852	28,519	2023/10/25
4. 75% POLAND GOV' T	国債証券	4.75	440	458	15,341	2016/10/25
4. 75% POLAND GOV' T	国債証券	4.75	270	285	9,536	2017/ 4/25
5. 25% POLAND GOV' T	国債証券	5.25	460	497	16,625	2017/10/25
5. 25% POLAND GOV' T	国債証券	5.25	330	377	12,622	2020/10/25
5. 5% POLAND GOV' T	国債証券	5.5	310	351	11,770	2019/10/25
5. 75% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	510	605	20,248	2021/10/25
5. 75% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	794	26,579	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	183,680	—
(オーストラリア)						
		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
2. 75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	250	254	24,497	2019/10/21
2. 75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	390	384	37,022	2024/ 4/21
3. 25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	380	388	37,341	2025/ 4/21
3. 25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	320	319	30,725	2029/ 4/21
3. 75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	150	153	14,800	2037/ 4/21
4. 25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	60	62	6,034	2017/ 7/21
4. 50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	540	593	57,089	2020/ 4/15
4. 520% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	140	159	15,365	2033/ 4/21
4. 75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	480	494	47,514	2016/ 6/15
4. 75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	320	371	35,714	2027/ 4/21
5. 25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.25	280	311	29,919	2019/ 3/15
5. 50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	510	554	53,324	2018/ 1/21
5. 50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	310	369	35,537	2023/ 4/21
5. 75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	320	376	36,240	2021/ 5/15
5. 75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	650	779	74,957	2022/ 7/15
6. 00% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	6.0	390	416	40,049	2017/ 2/15
小計	—	—	—	—	576,134	—
(シンガポール)						
		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
0. 50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	0.5	190	185	16,777	2018/ 4/ 1
2. 25% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.25	50	50	4,598	2021/ 6/ 1
2. 50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.5	60	62	5,638	2019/ 6/ 1
2. 75% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	110	106	9,581	2042/ 4/ 1
3. 00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	220	231	20,931	2024/ 9/ 1
3. 125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	60	64	5,798	2022/ 9/ 1
3. 25% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.25	100	107	9,688	2020/ 9/ 1
3. 375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	60	64	5,809	2033/ 9/ 1
3. 50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	140	153	13,846	2027/ 3/ 1
3. 75% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.75	90	93	8,422	2016/ 9/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)						
4.00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	4.0	千シンガポールドル 130	千シンガポールドル 141	千円 12,776	2018/ 9/ 1
小計	—	—	—	—	113,868	—
(マレーシア)						
3.314% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.314	千マレーシア リンギット 250	千マレーシア リンギット 249	千円 8,340	2017/10/31
3.394% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.394	570	570	19,053	2017/ 3/15
3.48% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.48	300	290	9,716	2023/ 3/15
3.492% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.492	410	406	13,574	2020/ 3/31
3.502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	407	13,612	2027/ 5/31
3.58% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.58	550	551	18,414	2018/ 9/28
3.889% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.889	300	302	10,109	2020/ 7/31
3.955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	200	200	6,711	2025/ 9/15
4.012% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.012	70	71	2,371	2017/ 9/15
4.048% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	250	252	8,440	2021/ 9/30
4.16% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	330	338	11,309	2021/ 7/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	160	162	5,431	2024/ 7/15
4.24% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.24	440	448	14,993	2018/ 2/ 7
4.262% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.262	250	253	8,466	2016/ 9/15
4.378% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.378	210	216	7,232	2019/11/29
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	130	135	4,537	2030/ 4/15
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	189	6,342	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	168,657	—
(南アフリカ)						
10.5% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	10.5	千南アフリカランド 2,670	千南アフリカランド 3,139	千円 31,773	2026/12/21
6.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.25	1,510	1,155	11,696	2036/ 3/31
6.50% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.5	2,760	2,125	21,509	2041/ 2/28
6.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.75	3,580	3,418	34,599	2021/ 3/31
7.00% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.0	2,160	1,862	18,851	2031/ 2/28
7.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.25	30	29	300	2020/ 1/15
7.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.75	360	356	3,606	2023/ 2/28
8.00% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.0	2,980	3,042	30,790	2018/12/21
8.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	1,890	1,872	18,945	2048/ 2/28
小計	—	—	—	—	172,072	—
合計	—	—	—	—	31,998,479	—

(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り捨て。

日立外国債券インデックスマザーファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額 総
	円	騰落率			
11期(2011年3月31日)	14,114	△ 6.3	98.3	—	百万円 29,320
12期(2012年4月2日)	14,921	5.7	98.7	—	22,267
13期(2013年4月1日)	17,395	16.6	98.7	—	25,045
14期(2014年3月31日)	19,973	14.8	98.5	—	27,974
15期(2015年3月31日)	22,540	12.9	98.8	—	31,958

(注) 債券先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		シティ世界国債インデックス (除く日本/円ベース(為替ヘッジなし))		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰落率		騰落率		
(期首) 2014年 3月31日	19,973	—	20,884	—	98.5	—
4月末	20,062	0.4	20,989	0.5	98.5	—
5月末	20,001	0.1	20,916	0.2	98.6	—
6月末	20,070	0.5	20,989	0.5	98.6	—
7月末	20,281	1.5	21,201	1.5	98.6	—
8月末	20,590	3.1	21,536	3.1	98.6	—
9月末	21,168	6.0	22,145	6.0	98.6	—
10月末	21,212	6.2	22,193	6.3	98.6	—
11月末	23,004	15.2	24,071	15.3	98.8	—
12月末	23,251	16.4	24,335	16.5	98.7	—
2015年 1月末	22,570	13.0	23,615	13.1	98.7	—
2月末	22,619	13.2	23,678	13.4	98.7	—
(期末) 2015年 3月31日	22,540	12.9	23,581	12.9	98.8	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

(注3) シティ世界国債インデックス(除く日本/円ベース(為替ヘッジなし))は、シティ世界国債インデックスを基に、日立投資顧問が計算したものでファンド設定日前日である2001年3月28日を10,000としています。シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数です。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期
	(2014.4.1~2015.3.31)
	金 額
(a) その他費用 (保管費用) (その他)	6円 (6) (0)
合 計	6

(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。
(a)その他費用は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買及び取引の状況(2014年4月1日から2015年3月31日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額	
外 国	ア メ リ カ	千米ドル 45,763	千米ドル 40,959	
	カ ナ ダ	千カナダドル 2,167	千カナダドル 1,885	
	メ キ シ コ	千メキシコペソ 12,318	千メキシコペソ 7,323	
	ユ ー ロ	ド イ ツ	千ユーロ 3,078	千ユーロ 3,080
		イ タ リ ア	3,918	3,055
		フ ラ ン ス	3,783	2,988
		オ ラ ン ダ	1,076	779
		ス ペ イ ン	2,481	1,878
		ベ ル ギ ー	800	815
		オ ー ス ト リ ア	358	253
		フ ィ ン ラ ン ド	201	149
		ア イ ル ラ ン ド	300	32
	イ ギ リ ス	千英ポンド 2,167	千英ポンド 1,807	
	ス イ ス	千スイスフラン 66	千スイスフラン 82	
	ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 1,666	千スウェーデンクローナ 1,435	
	ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 1,133	千ノルウェークローネ 1,279	
	デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 2,587	千デンマーククローネ 2,540	
	ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 1,312	千ポーランドズロチ 1,406	
	オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 1,306	千オーストラリアドル 564	
シ ン ガ ポ ール	千シンガポールドル 319	千シンガポールドル 121		
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 1,069	千マレーシアリンギット 689		
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド 5,038	千南アフリカランド 1,841		

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利分は含まれておりません。)
(注2) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2014年4月1日から2015年3月31日まで)

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
2.5% US TREASURY N/B(アメリカ)	315,319	2.5% US TREASURY N/B(アメリカ)	167,276
2.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	174,258	4.25% US TREASURY N/B(アメリカ)	122,332
3.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	126,038	2.00% UK TREASURY(イギリス)	108,358
3.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	124,808	2.125% US TREASURY N/B(アメリカ)	107,038
2.75% US TREASURY N/B(アメリカ)	123,917	0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	102,662
0.5% US TREASURY N/B(アメリカ)	118,079	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	101,776
2.50% US TREASURY N/B(アメリカ)	107,723	0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	101,536
0.5% US TREASURY N/B(アメリカ)	106,156	3.00% FRANCE GOV'T(ユーロ・フランス)	101,477
2.25% FRANCE GOV'T(ユーロ・フランス)	102,944	0.25% US TREASURY N/B(アメリカ)	100,867
0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	102,825	2.00% US TREASURY N/B(アメリカ)	99,871

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利分は含まれておりません。)
(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等(2014年4月1日から2015年3月31日まで)
 期中の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(2015年3月31日現在)

公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千米ドル 105,000	千米ドル 110,584	千円 13,288,928	% 41.6	% —	% 16.0	% 16.5	% 9.1
カ ナ ダ	千カナダドル 6,380	千カナダドル 7,442	705,416	2.2	—	1.1	0.5	0.6
メ キ シ コ	千メキシコペソ 38,470	千メキシコペソ 42,610	336,193	1.1	—	0.6	0.2	0.2
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	15,330	18,863	2,458,314	7.7	—	4.6	2.2	1.0
イ タ リ ア	19,240	23,886	3,112,929	9.7	—	5.9	2.8	1.0
フ ラ ン ス	18,800	23,386	3,047,754	9.5	—	6.0	2.5	1.0
オ ラ ン ダ	5,150	6,332	825,277	2.6	—	1.5	0.7	0.3
ス ペ イ ン	10,370	12,786	1,666,369	5.2	—	3.2	1.2	0.8
ベルギー	4,880	6,360	828,859	2.6	—	1.8	0.5	0.3
オーストリア	3,020	3,893	507,382	1.6	—	1.1	0.4	0.2
フィンランド	1,320	1,536	200,274	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	1,670	2,061	268,629	0.8	—	0.5	0.4	0.0
イ ギ リ ス	千英ポンド 11,800	千英ポンド 14,559	2,592,668	8.1	—	5.9	1.9	0.4
ス イ ス	千スイスフラン 750	千スイスフラン 888	110,626	0.3	—	0.1	0.2	0.0
スウェーデン	千スウェーデン クローナ 8,760	千スウェーデン クローナ 10,683	149,459	0.5	—	0.3	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークロ ネ 4,890	千ノルウェークロ ネ 5,362	80,546	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククロ ネ 9,580	千デンマーククロ ネ 13,075	228,030	0.7	—	0.5	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロ チ 5,290	千ポーランドズロ チ 5,916	188,788	0.6	—	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリア ドル 5,110	千オーストラリア ドル 5,796	533,619	1.7	—	1.1	0.3	0.3
シンガポール	千シンガポールド ル 1,310	千シンガポールド ル 1,353	118,263	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシア リングgit 4,830	千マレーシア リングgit 4,854	157,592	0.5	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカラン ド 17,540	千南アフリカラン ド 16,930	167,782	0.5	—	0.4	0.1	—
合 計	—	—	31,573,706	98.8	—	51.8	31.5	15.5

(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) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示
外国(外貨建)公社債銘柄別

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
0.250% US TREASURY N/B	国債証券	0.25	730	729	87,621	2016/ 5/15
0.375% US TREASURY N/B	国債証券	0.375	1,000	1,000	120,216	2016/ 4/30
0.375% US TREASURY N/B	国債証券	0.375	550	550	66,108	2016/ 5/31
0.5% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	1,000	1,000	120,207	2016/ 9/30
0.5% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	900	899	108,123	2016/11/30
0.5% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	410	408	49,034	2017/ 7/31
0.50% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	940	941	113,109	2016/ 6/15
0.50% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	600	600	72,192	2016/ 6/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	850	852	102,415	2016/ 7/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	750	751	90,296	2016/10/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	600	601	72,231	2016/11/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	450	450	54,156	2016/12/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	500	500	60,131	2017/ 2/15
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	570	569	68,454	2017/ 5/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	820	817	98,246	2017/ 8/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	610	607	73,034	2017/ 9/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	770	765	92,017	2017/11/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	280	277	33,287	2018/ 4/30
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	740	742	89,238	2017/ 1/15
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	750	752	90,409	2017/ 3/15
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	730	730	87,833	2017/ 6/30
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	390	389	46,807	2017/10/31
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	690	687	82,664	2017/12/31
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	790	786	94,489	2018/ 2/28
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	460	457	54,958	2018/ 3/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	490	492	59,219	2016/ 9/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	800	804	96,706	2016/11/30
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	810	814	97,938	2016/12/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	720	724	87,009	2017/ 1/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	80	80	9,666	2017/ 2/28
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	560	562	67,631	2017/ 4/30
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	60	60	7,245	2017/ 5/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	590	592	71,210	2017/ 6/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	550	552	66,351	2017/ 7/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	720	721	86,698	2017/10/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	450	449	54,046	2018/ 1/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	340	333	40,126	2019/ 7/31
1% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	690	693	83,383	2017/ 9/15
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	710	715	85,970	2016/ 8/31
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	390	393	47,239	2016/ 9/30
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	600	604	72,687	2016/10/31
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	800	806	96,894	2017/ 3/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	600	601	72,287	2018/ 2/15
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	640	639	76,878	2018/ 5/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	300	295	35,524	2019/ 8/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	400	393	47,320	2019/ 9/30
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	370	363	43,691	2019/11/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	430	427	51,382	2019/ 5/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	450	443	53,307	2020/ 3/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	660	649	78,103	2020/ 4/30

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	670	672	80,765	2018/11/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	510	510	61,396	2019/ 1/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	330	329	39,634	2019/ 4/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	330	328	39,473	2019/10/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	690	684	82,301	2020/ 2/29
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	707	84,966	2018/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	790	796	95,772	2018/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	460	463	55,710	2018/11/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	510	513	61,717	2018/12/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	530	533	64,053	2019/ 2/28
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	720	719	86,468	2020/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	630	627	75,387	2020/ 5/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	520	527	63,381	2016/ 7/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	620	628	75,524	2018/ 8/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	500	505	60,699	2019/ 3/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	610	613	73,716	2019/11/30
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	700	706	84,874	2019/ 5/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	710	719	86,487	2016/ 6/30
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	710	718	86,293	2018/12/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	690	697	83,837	2019/ 1/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	840	848	102,015	2019/ 2/28
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	330	331	39,882	2019/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	510	517	62,201	2019/ 3/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	510	517	62,167	2019/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	480	486	58,470	2019/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	668	80,346	2019/ 7/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	550	556	66,924	2019/ 8/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	890	880	105,764	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,000	987	118,658	2022/11/15
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	480	490	58,938	2018/10/31
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	100	101	12,222	2019/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	690	689	82,897	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,130	1,120	134,614	2023/ 5/15
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	700	718	86,399	2017/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	650	667	80,234	2017/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	540	554	66,671	2017/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	530	535	64,327	2021/11/30
2.0% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	360	366	44,041	2016/ 4/30
2.0% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,200	1,215	146,119	2023/ 2/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	350	358	43,091	2020/ 9/30
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	735	88,421	2021/ 2/28
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	520	530	63,747	2021/ 5/31
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	885	106,450	2021/11/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	780	794	95,424	2022/ 2/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	680	701	84,301	2020/ 8/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	570	586	70,503	2021/ 1/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	510	523	62,943	2021/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	1,006	120,931	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	720	738	88,719	2021/12/31
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	520	537	64,636	2021/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	670	694	83,514	2017/11/30
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	270	280	33,703	2018/ 7/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	610	633	76,138	2017/ 7/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	380	396	47,630	2018/ 5/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	570	594	71,429	2018/ 6/30
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	480	500	60,200	2020/12/31
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	120	124	15,001	2017/ 6/30
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,350	1,414	169,922	2024/ 5/15
2.50% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,010	1,059	127,354	2023/ 8/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	320	327	39,409	2016/ 4/30
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	220	230	27,717	2018/ 1/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	820	867	104,213	2020/ 8/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,320	1,395	167,708	2020/11/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	670	694	83,495	2016/11/30
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	530	553	66,546	2017/ 5/31
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	300	315	37,912	2017/12/31
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	220	231	27,835	2018/ 2/28
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,090	1,164	139,959	2024/ 2/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	290	300	36,164	2042/ 8/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	660	684	82,286	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	410	433	52,110	2019/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,210	1,293	155,481	2023/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	390	412	49,535	2018/ 3/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	960	1,020	122,645	2043/ 5/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	460	476	57,286	2016/ 8/31
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	620	643	77,334	2016/ 9/30
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	240	251	30,163	2017/ 2/28
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	170	185	22,235	2042/ 5/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	640	699	84,022	2044/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	250	260	31,293	2016/10/31
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	600	627	75,442	2017/ 1/31
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	580	609	73,265	2017/ 4/30
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	730	784	94,228	2019/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	930	1,009	121,309	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	301	36,177	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	412	49,551	2042/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	640	715	85,969	2044/ 8/15
3.250% US TREASURY N/B	国債証券	3.25	330	341	40,997	2016/ 5/31
3.250% US TREASURY N/B	国債証券	3.25	370	383	46,046	2016/ 6/30
3.250% US TREASURY N/B	国債証券	3.25	500	518	62,361	2016/ 7/31
3.250% US TREASURY N/B	国債証券	3.25	500	523	62,906	2016/12/31
3.250% US TREASURY N/B	国債証券	3.25	580	610	73,352	2017/ 3/31
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	860	937	112,695	2019/11/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	720	841	101,143	2044/ 5/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	290	311	37,430	2018/ 2/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	1,220	1,343	161,394	2020/ 5/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	140	165	19,882	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	580	636	76,537	2019/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,230	1,359	163,386	2020/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,150	1,279	153,796	2021/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	780	950	114,236	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	960	1,171	140,770	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	410	448	53,842	2018/11/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	60	74	8,944	2041/ 8/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	930	1,158	139,261	2043/11/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	440	479	57,575	2018/ 5/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	40	50	6,041	2040/ 8/15
4.00% US TREASURY N/B	国債証券	4.0	300	329	39,608	2018/ 8/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	490	533	64,118	2017/11/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	340	448	53,868	2039/ 5/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	80	106	12,784	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	250	336	40,418	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	770	1,038	124,822	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	50	68	8,175	2041/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	400	432	51,984	2017/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	40	4,901	2038/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	470	642	77,205	2039/ 8/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	330	448	53,919	2036/ 2/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	470	501	60,252	2016/11/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	330	355	42,667	2017/ 2/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	700	976	117,286	2040/ 2/15
4.75% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	370	529	63,661	2041/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	350	383	46,045	2017/ 8/15
4.875% US TREASURY N/B	国債証券	4.875	460	488	58,655	2016/ 8/15
5.00% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	130	188	22,671	2037/ 5/15
5.125% US TREASURY N/B	国債証券	5.125	400	421	50,647	2016/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	170	231	27,808	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	163	19,671	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	260	368	44,244	2031/ 2/15
5.50% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	166	20,015	2028/ 8/15
6.00% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	140	194	23,373	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	130	187	22,542	2027/11/15
6.25% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	268	32,301	2023/ 8/15
6.25% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	190	288	34,619	2030/ 5/15
6.50% US TREASURY N/B	国債証券	6.5	90	131	15,786	2026/11/15
7.25% US TREASURY N/B	国債証券	7.25	390	420	50,509	2016/ 5/15
7.50% US TREASURY N/B	国債証券	7.5	330	367	44,151	2016/11/15
8.00% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	260	362	43,592	2021/11/15
8.125% US TREASURY N/B	国債証券	8.125	140	180	21,732	2019/ 8/15
8.75% US TREASURY N/B	国債証券	8.75	310	363	43,646	2017/ 5/15
8.75% US TREASURY N/B	国債証券	8.75	210	289	34,754	2020/ 8/15
8.875% US TREASURY N/B	国債証券	8.875	40	51	6,227	2019/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	330	342	41,102	2024/ 8/15
小計	—	—	—	—	13,288,928	—
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
1.00% CANADA GOV' T	国債証券	1.0	300	301	28,574	2016/ 5/ 1
1.00% CANADA GOV' T	国債証券	1.0	300	301	28,623	2016/ 8/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	180	183	17,414	2018/ 2/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	140	143	13,594	2018/ 9/ 1
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	340	346	32,842	2017/ 3/ 1
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	140	143	13,589	2017/ 9/ 1
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	310	317	30,119	2023/ 6/ 1
1.75% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	100	104	9,910	2019/ 9/ 1
1.75% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	200	208	19,794	2019/ 3/ 1
2.00% CANADA GOV' T	国債証券	2.0	380	386	36,635	2016/ 6/ 1
2.50% CANADA GOV' T	国債証券	2.5	100	110	10,481	2024/ 6/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	290	299	28,357	2016/ 9/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	190	212	20,119	2022/ 6/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	60	71	6,735	2048/12/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	90	111	10,604	2064/12/ 1
3.25% CANADA GOV' T	国債証券	3.25	310	354	33,555	2021/ 6/ 1
3.50% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	220	250	23,702	2020/ 6/ 1
3.50% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	200	268	25,476	2045/12/ 1
3.75% CANADA GOV' T	国債証券	3.75	350	394	37,437	2019/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	330	343	32,543	2016/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	280	301	28,542	2017/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	310	435	41,315	2041/ 6/ 1
4.25% CANADA GOV' T	国債証券	4.25	170	189	17,998	2018/ 6/ 1
5.00% CANADA GOV' T	国債証券	5.0	330	510	48,386	2037/ 6/ 1
5.75% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	270	408	38,673	2029/ 6/ 1
5.75% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	300	479	45,487	2033/ 6/ 1
8.00% CANADA GOV' T	国債証券	8.0	100	172	16,302	2027/ 6/ 1
CANADA GOV' T	国債証券	1.0	90	90	8,598	2016/11/ 1
小計	—	—	—	—	705,416	—
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
4.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	4.75	2,800	2,794	22,050	2018/ 6/14
5.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.0	3,850	3,925	30,971	2017/ 6/15
6.25% MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.25	3,750	3,862	30,472	2016/ 6/16
6.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	900	940	7,421	2022/ 6/ 9
7.25% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.25	4,100	4,326	34,137	2016/12/15
7.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	3,100	3,446	27,191	2027/ 6/ 3
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	1,670	1,807	14,258	2017/12/14
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,649	20,905	2031/ 5/29
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	900	1,042	8,227	2034/11/23
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	3,400	3,995	31,522	2042/11/13
8.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	3,040	3,396	26,801	2020/ 6/11
8.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	1,550	1,779	14,042	2023/12/ 7
8.5% MEXICAN BONOS	国債証券	8.5	900	1,006	7,938	2018/12/13
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	2,980	3,631	28,654	2029/ 5/31
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,210	4,004	31,597	2038/11/18
小計	—	—	—	—	336,193	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	80	80	10,473	2016/ 3/11
0.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	410	415	54,184	2018/ 4/13
0.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	180	185	24,161	2025/ 2/15
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	380	385	50,259	2017/ 4/ 7
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	390	397	51,770	2017/10/13
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	410	418	54,547	2018/ 2/23
0.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.75	370	376	49,129	2017/ 2/24
1% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	270	291	37,937	2024/ 8/15
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	330	344	44,833	2018/10/12
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	360	376	49,059	2019/ 2/22
1.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.25	370	378	49,322	2016/10/14
1.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	130	146	19,042	2024/ 5/15
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	400	444	57,862	2022/ 9/ 4
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	410	457	59,607	2023/ 2/15
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	420	469	61,198	2023/ 5/15
1.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	400	451	58,784	2022/ 7/ 4

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	210	240	31,346	2024/ 2/15
2.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	420	477	62,243	2022/ 1/ 4
2.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	270	313	40,883	2023/ 8/15
2.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	260	293	38,223	2020/ 9/ 4
2.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	370	424	55,374	2021/ 9/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	330	379	49,417	2021/ 1/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	310	468	61,079	2044/ 7/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	160	245	31,973	2046/ 8/15
2.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.75	430	443	57,746	2016/ 4/ 8
3.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.0	430	500	65,205	2020/ 7/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	360	418	54,529	2020/ 1/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	400	483	62,954	2021/ 7/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	160	267	34,867	2042/ 7/ 4
3.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.5	370	428	55,779	2019/ 7/ 4
3.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.75	530	567	73,939	2017/ 1/ 4
3.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.75	430	493	64,359	2019/ 1/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	510	537	70,012	2016/ 7/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	440	491	64,066	2018/ 1/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	370	632	82,390	2037/ 1/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	400	440	57,418	2017/ 7/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	580	664	86,628	2018/ 7/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	290	531	69,277	2039/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	210	330	43,070	2028/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	330	587	76,571	2034/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	350	692	90,266	2040/ 7/ 4
5.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	290	514	67,002	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	270	449	58,617	2028/ 1/ 4
6.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	160	246	32,133	2024/ 1/ 4
6.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	170	313	40,901	2030/ 1/ 4
6.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	210	367	47,857	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.75	120	121	15,827	2018/ 1/15
1.05% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.05	240	244	31,914	2019/12/ 1
1.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	120	124	16,268	2019/ 8/ 1
2.15% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	190	204	26,647	2021/12/15
2.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	360	368	48,041	2016/ 5/15
2.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	120	132	17,272	2024/12/ 1
2.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	510	550	71,753	2019/ 5/ 1
2.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.75	240	250	32,584	2016/11/15
3.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	90	111	14,522	2046/ 9/ 1
3.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	170	210	27,416	2030/ 3/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	200	216	28,211	2017/11/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	330	362	47,228	2018/ 6/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	400	444	57,914	2018/12/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	360	373	48,693	2016/ 4/15
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	580	608	79,236	2016/ 8/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	530	620	80,818	2021/ 3/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	739	96,395	2021/ 8/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	430	521	67,939	2024/ 9/ 1
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	530	566	73,890	2017/ 2/ 1
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	320	375	48,979	2020/ 9/ 1
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	380	508	66,324	2037/ 2/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	270	308	40,249	2019/ 2/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	557	72,599	2019/ 9/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	563	73,431	2020/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	490	547	71,366	2018/ 2/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	550	624	81,388	2018/ 8/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	490	566	73,844	2019/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	430	508	66,314	2020/ 2/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	420	527	68,729	2023/ 5/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	470	597	77,898	2024/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	260	340	44,373	2026/ 3/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	380	405	52,824	2016/ 9/15
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	360	393	51,297	2017/ 5/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	130	142	18,579	2017/ 6/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	540	668	87,086	2021/ 9/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	480	615	80,168	2023/ 8/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	170	233	30,398	2028/ 9/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	320	499	65,151	2044/ 9/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	460	583	76,102	2022/ 3/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	360	481	62,753	2025/ 3/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	420	622	81,116	2034/ 8/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	350	541	70,566	2039/ 8/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	380	593	77,283	2040/ 9/ 1
5.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	580	647	84,338	2017/ 8/ 1
5.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	570	827	107,895	2029/11/ 1
5.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	410	538	70,203	2022/ 9/ 1
5.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	390	513	66,971	2022/11/ 1
5.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	350	554	72,199	2033/ 2/ 1
6.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	570	908	118,428	2031/ 5/ 1
6.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	510	797	103,968	2027/11/ 1
7.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	220	354	46,248	2026/11/ 1
9.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	163	21,269	2023/11/ 1
(ユーロ…フランス)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0% FRANCE GOV' T	国債証券	—	40	39	5,194	2020/ 5/25
0.5% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	180	184	23,992	2019/11/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	410	420	54,863	2017/ 7/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	530	548	71,473	2018/ 5/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	490	509	66,347	2018/11/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	440	458	59,754	2019/ 5/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	390	404	52,690	2017/ 2/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	510	569	74,212	2023/ 5/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	580	652	84,973	2024/11/25
2.25% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	520	597	77,917	2022/10/25
2.25% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	570	665	86,769	2024/ 5/25
2.5% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	520	648	84,572	2030/ 5/25
2.50% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	570	590	76,889	2016/ 7/25
2.50% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	600	680	88,724	2020/10/25
2.75% FRANCE GOV' T	国債証券	2.75	560	702	91,545	2027/10/25
3.00% FRANCE GOV' T	国債証券	3.0	650	777	101,378	2022/ 4/25
3.25% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	690	715	93,193	2016/ 4/25
3.25% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	560	673	87,735	2021/10/25
3.25% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	70	108	14,112	2045/ 5/25
3.50% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	700	822	107,188	2020/ 4/25

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
3.50% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	600	789	102,877	2026/ 4/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	700	756	98,613	2017/ 4/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	570	668	87,058	2019/10/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	720	878	114,454	2021/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	610	687	89,567	2018/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	410	670	87,434	2038/10/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	310	581	75,801	2055/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	260	501	65,320	2060/ 4/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	400	445	58,018	2017/10/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	550	634	82,749	2018/10/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	650	763	99,455	2019/ 4/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	620	826	107,647	2023/10/25
4.50% FRANCE GOV' T	国債証券	4.5	340	610	79,609	2041/ 4/25
4.75% FRANCE GOV' T	国債証券	4.75	410	699	91,105	2035/ 4/25
5.00% FRANCE GOV' T	国債証券	5.0	610	659	85,942	2016/10/25
5.50% FRANCE GOV' T	国債証券	5.5	510	838	109,272	2029/ 4/25
5.75% FRANCE GOV' T	国債証券	5.75	480	868	113,178	2032/10/25
6.00% FRANCE GOV' T	国債証券	6.0	220	344	44,892	2025/10/25
8.50% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	80	111	14,478	2019/10/25
8.50% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	170	281	36,749	2023/ 4/25
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.00% NETHERLANDS GOVT	国債証券	—	140	140	18,283	2016/ 4/15
0.50% NETHERLANDS GOV' TT	国債証券	0.5	270	273	35,682	2017/ 4/15
1.25% NETHERLANDS GOVT	国債証券	1.25	240	249	32,515	2018/ 1/15
1.25% NETHERLANDS GOVT	国債証券	1.25	200	210	27,395	2019/ 1/15
1.75% NETHERLANDS GOVT	国債証券	1.75	330	371	48,398	2023/ 7/15
2.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.0	70	81	10,566	2024/ 7/15
2.25% NETHERLANDS GOVT	国債証券	2.25	370	426	55,624	2022/ 7/15
2.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	2.5	280	293	38,255	2017/ 1/15
2.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	2.5	240	319	41,591	2033/ 1/15
2.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.75	90	141	18,432	2047/ 1/15
3.25% NETHERLANDS GOVT	国債証券	3.25	240	288	37,544	2021/ 7/15
3.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	3.5	320	379	49,454	2020/ 7/15
3.75% NETHERLANDS GOVT	国債証券	3.75	290	370	48,261	2023/ 1/15
3.75% NETHERLANDS GOVT	国債証券	3.75	260	460	59,986	2042/ 1/15
4.00% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.0	350	368	48,084	2016/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.0	300	340	44,409	2018/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.0	270	317	41,333	2019/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.0	250	424	55,298	2037/ 1/15
4.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	4.5	310	343	44,742	2017/ 7/15
5.5% NETHERLANDS GOVT	国債証券	5.5	250	407	53,076	2028/ 1/15
7.50% NETHERLANDS GOVT	国債証券	7.5	80	125	16,340	2023/ 1/15
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.4% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	150	155	20,300	2020/ 1/31
1.6% SPANISH GOV' T	国債証券	1.6	180	184	24,083	2025/ 4/30
2.75% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	120	131	17,084	2019/ 4/30
2.75% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	240	271	35,364	2024/10/31
3.25% SPANISH GOV' T	国債証券	3.25	480	496	64,749	2016/ 4/30
3.30% SPANISH GOV' T	国債証券	3.3	380	396	51,690	2016/ 7/30
3.75% SPANISH GOV' T	国債証券	3.75	420	470	61,269	2018/10/31
3.80% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	470	501	65,384	2017/ 1/31
3.80% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	470	572	74,645	2024/ 4/30

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
4.00% SPANISH GOV' T	国債証券	4.0	450	525	68,490	2020/ 4/30
4.10% SPANISH GOV' T	国債証券	4.1	420	472	61,570	2018/ 7/30
4.20% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	390	543	70,809	2037/ 1/31
4.25% SPANISH GOV' T	国債証券	4.25	470	501	65,329	2016/10/31
4.30% SPANISH GOV' T	国債証券	4.3	340	398	51,872	2019/10/31
4.40% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	240	302	39,461	2023/10/31
4.50% SPANISH GOV' T	国債証券	4.5	370	414	54,004	2018/ 1/31
4.60% SPANISH GOV' T	国債証券	4.6	350	411	53,662	2019/ 7/30
4.65% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	350	461	60,180	2025/ 7/30
4.70% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	210	322	42,011	2041/ 7/30
4.80% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	370	481	62,790	2024/ 1/31
4.85% SPANISH GOV' T	国債証券	4.85	430	526	68,657	2020/10/31
4.90% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	260	407	53,159	2040/ 7/30
5.15% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	310	442	57,673	2028/10/31
5.15% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	60	100	13,064	2044/10/31
5.40% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	390	515	67,220	2023/ 1/31
5.50% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	420	471	61,494	2017/ 7/30
5.50% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	450	574	74,905	2021/ 4/30
5.75% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	370	590	76,985	2032/ 7/30
5.85% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	410	542	70,748	2022/ 1/31
5.90% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	270	395	51,548	2026/ 7/30
6.00% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	200	26,154	2029/ 1/31
(ユーロ…ベルギー)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	290	302	39,433	2018/ 6/22
2.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	190	220	28,710	2023/ 6/22
2.60% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	200	240	31,318	2024/ 6/22
2.75% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.75	200	205	26,817	2016/ 3/28
3.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	130	147	19,232	2019/ 9/28
3.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	90	124	16,168	2034/ 6/22
3.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.25	280	294	38,354	2016/ 9/28
3.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.5	230	248	32,440	2017/ 6/28
3.75% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	300	361	47,110	2020/ 9/28
3.75% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	120	203	26,544	2045/ 6/22
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	160	173	22,586	2017/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	200	224	29,277	2018/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	210	243	31,778	2019/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	310	392	51,210	2022/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	210	317	41,318	2032/ 3/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	270	342	44,623	2021/ 9/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	220	285	37,265	2022/ 9/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	270	474	61,889	2041/ 3/28
4.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	180	256	33,455	2026/ 3/28
5.0% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	330	580	75,702	2035/ 3/28
5.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	150	171	22,312	2017/ 9/28
5.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	340	547	71,310	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.15	240	250	32,640	2018/10/19
1.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	40	44	5,845	2024/10/21
1.75% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	100	112	14,650	2023/10/20
3.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	110	178	23,287	2044/ 6/20
3.20% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.2	250	265	34,652	2017/ 2/20
3.40% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	190	235	30,728	2022/11/22

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
3.50% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	290	353	46,114	2021/ 9/15
3.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	150	186	24,337	2022/ 4/20
3.80% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	105	13,728	2062/ 1/26
3.90% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.9	240	289	37,685	2020/ 7/15
4.00% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.0	120	127	16,590	2016/ 9/15
4.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	290	493	64,285	2037/ 3/15
4.30% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.3	240	266	34,701	2017/ 9/15
4.35% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.35	290	340	44,372	2019/ 3/15
4.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.65	50	56	7,388	2018/ 1/15
4.85% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	265	34,576	2026/ 3/15
6.25% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	190	320	41,796	2027/ 7/15
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.375%FINNISH GOV' T	国債証券	0.375	40	40	5,316	2020/ 9/15
1.50% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	110	121	15,813	2023/ 4/15
1.625%FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	140	155	20,226	2022/ 9/15
1.75% FINNISH GOV' T	国債証券	1.75	100	102	13,296	2016/ 4/15
1.875%FINNISH GOV' T	国債証券	1.875	50	52	6,792	2017/ 4/15
2.00% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	90	103	13,526	2024/ 4/15
2.625%FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	40	59	7,787	2042/ 7/ 4
2.75% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	100	128	16,787	2028/ 7/ 4
3.375%FINNISH GOV' T	国債証券	3.375	110	128	16,773	2020/ 4/15
3.50% FINNISH GOV' T	国債証券	3.5	160	193	25,179	2021/ 4/15
3.875%FINNISH GOV' T	国債証券	3.875	150	164	21,500	2017/ 9/15
4.00% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	70	95	12,488	2025/ 7/ 4
4.375%FINNISH GOV' T	国債証券	4.375	160	190	24,783	2019/ 7/ 4
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
2.00% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	80	90	11,839	2045/ 2/18
2.40% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	90	106	13,930	2030/ 5/15
3.40% IRISH GOV' T 2024	国債証券	3.4	140	172	22,541	2024/ 3/18
3.90% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	80	100	13,128	2023/ 3/20
4.40% IRISH GOV' T	国債証券	4.4	270	319	41,629	2019/ 6/18
4.50% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	40	46	6,042	2018/10/18
4.50% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	50	60	7,908	2020/ 4/18
4.6% IRISH GOV' T	国債証券	4.6	30	31	4,097	2016/ 4/18
5.00% IRISH GOVT	国債証券	5.0	250	314	41,005	2020/10/18
5.40% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	190	273	35,650	2025/ 3/13
5.50% IRISH GOV' T	国債証券	5.5	200	228	29,733	2017/10/18
5.90% IRISH GOV' T	国債証券	5.9	250	315	41,122	2019/10/18
小 計	—	—	—	—	12,915,791	—
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
1.00% UK TREASURY	国債証券	1.0	600	606	108,027	2017/ 9/ 7
1.25% UK TREASURY	国債証券	1.25	380	385	68,701	2018/ 7/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	370	378	67,480	2017/ 1/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	500	515	91,750	2019/ 7/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	510	522	93,004	2022/ 9/ 7
2% UK TREASURY	国債証券	2.0	120	125	22,270	2020/ 7/22
2.25% UK TREASURY	国債証券	2.25	550	582	103,658	2023/ 9/ 7
2.75% UK TREASURY	国債証券	2.75	120	132	23,530	2024/ 9/ 7
3.25% UK TREASURY	国債証券	3.25	160	191	34,135	2044/ 1/22
3.50% UK TREASURY	国債証券	3.5	300	414	73,763	2068/ 7/22
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	320	358	63,786	2019/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	460	523	93,191	2020/ 9/ 7

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)						
		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	440	507	90,448	2021/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	320	438	78,014	2052/ 7/22
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	250	263	46,832	2016/ 9/ 7
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	350	412	73,461	2022/ 3/ 7
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	280	418	74,470	2060/ 1/22
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	250	320	57,080	2027/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	380	502	89,475	2032/ 6/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	391	69,740	2036/ 3/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	240	331	58,955	2039/ 9/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	340	471	83,998	2040/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	360	520	92,753	2046/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	260	384	68,405	2049/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	537	95,792	2055/12/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	399	71,062	2019/ 3/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	360	496	88,349	2034/ 9/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	390	569	101,462	2042/12/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	380	447	79,657	2020/ 3/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	350	484	86,250	2030/12/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	320	470	83,781	2038/12/ 7
5.00% UK TREASURY	国債証券	5.0	410	462	82,288	2018/ 3/ 7
5.00% UK TREASURY	国債証券	5.0	350	460	81,969	2025/ 3/ 7
6.00% UK TREASURY	国債証券	6.0	190	287	51,230	2028/12/ 7
8.00% UK TREASURY	国債証券	8.0	30	42	7,499	2021/ 6/ 7
8.75% UK TREASURY	国債証券	8.75	170	204	36,386	2017/ 8/25
小計	—	—	—	—	2,592,668	—
(スイス)						
		%	千スイスフラン	千スイスフラン	千円	
2.00% SWITZERLAND	国債証券	2.0	60	68	8,507	2021/ 4/28
2.50% SWITZERLAND	国債証券	2.5	10	10	1,282	2016/ 3/12
3.00% SWITZERLAND	国債証券	3.0	150	165	20,627	2018/ 1/ 8
3.00% SWITZERLAND	国債証券	3.0	170	195	24,283	2019/ 5/12
4.00% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	132	16,539	2023/ 2/11
4.00% SWITZERLAND	国債証券	4.0	70	105	13,121	2028/ 4/ 8
4.25% SWITZERLAND	国債証券	4.25	190	211	26,263	2017/ 6/ 5
小計	—	—	—	—	110,626	—
(スウェーデン)						
		%	千スウェーデン クローナ	千スウェーデン クローナ	千円	
1.50% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	400	439	6,151	2023/11/13
3.00% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.0	1,230	1,281	17,928	2016/ 7/12
3.5% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,520	1,874	26,230	2022/ 6/ 1
3.5% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,160	1,806	25,269	2039/ 3/30
3.75% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.75	1,120	1,228	17,180	2017/ 8/12
4.25% SWEDEN GOV' T	国債証券	4.25	1,960	2,300	32,183	2019/ 3/12
5.00% SWEDEN GOV' T	国債証券	5.0	1,370	1,752	24,515	2020/12/ 1
小計	—	—	—	—	149,459	—
(ノルウェー)						
		%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
2.00% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,660	1,738	26,117	2023/ 5/24
3.75% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,400	1,607	24,144	2021/ 5/25
4.25% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.25	1,030	1,103	16,576	2017/ 5/19
4.50% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.5	800	912	13,707	2019/ 5/22
小計	—	—	—	—	80,546	—
(デンマーク)						
		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
1.50% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	540	601	10,483	2023/11/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)						
		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
2.50% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	2.5	640	671	11,702	2016/11/15
3.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	1,870	2,242	39,115	2021/11/15
4.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,260	1,406	24,534	2017/11/15
4.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,860	2,226	38,838	2019/11/15
4.50% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,450	4,617	80,520	2039/11/15
7.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	7.0	410	675	11,778	2024/11/10
KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	550	633	11,055	2025/11/15
小計	—	—	—	—	228,030	—
(ポーランド)						
		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
0.00% POLAND GOV' T	国債証券	—	90	86	2,765	2017/ 7/25
2.50% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	350	358	11,428	2018/ 7/25
3.25% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	170	179	5,737	2019/ 7/25
3.25% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	100	108	3,472	2025/ 7/25
4.00% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	780	888	28,354	2023/10/25
4.75% POLAND GOV' T	国債証券	4.75	440	461	14,722	2016/10/25
4.75% POLAND GOV' T	国債証券	4.75	270	287	9,161	2017/ 4/25
5.00% POLAND GOV' T	国債証券	5.0	820	849	27,105	2016/ 4/25
5.25% POLAND GOV' T	国債証券	5.25	460	501	15,996	2017/10/25
5.25% POLAND GOV' T	国債証券	5.25	330	387	12,354	2020/10/25
5.5% POLAND GOV' T	国債証券	5.5	310	358	11,453	2019/10/25
5.75% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	510	625	19,952	2021/10/25
5.75% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	823	26,283	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	188,788	—
(オーストラリア)						
		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
2.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	390	404	37,199	2024/ 4/21
3.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	380	409	37,735	2025/ 4/21
3.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	320	343	31,633	2029/ 4/21
3.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	20	22	2,107	2037/ 4/21
4.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	60	63	5,836	2017/ 7/21
4.50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	540	607	55,926	2020/ 4/15
4.520% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	140	174	16,089	2033/ 4/21
4.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	480	496	45,708	2016/ 6/15
4.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	320	394	36,337	2027/ 4/21
5.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.25	280	317	29,194	2019/ 3/15
5.50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	510	562	51,767	2018/ 1/21
5.50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	310	384	35,362	2023/ 4/21
5.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	320	388	35,757	2021/ 5/15
5.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	650	806	74,260	2022/ 7/15
6.00% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	6.0	390	420	38,700	2017/ 2/15
小計	—	—	—	—	533,619	—
(シンガポール)						
		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
0.50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	0.5	190	184	16,090	2018/ 4/ 1
1.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	1.125	150	150	13,103	2016/ 4/ 1
2.25% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.25	50	50	4,399	2021/ 6/ 1
2.50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.5	60	61	5,388	2019/ 6/ 1
2.75% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	110	106	9,344	2042/ 4/ 1
3.00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	220	232	20,318	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	60	63	5,570	2022/ 9/ 1
3.25% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.25	100	106	9,268	2020/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	60	65	5,688	2033/ 9/ 1
3.50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	90	99	8,700	2027/ 3/ 1
3.75% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.75	90	93	8,143	2016/ 9/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)						
4.00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	4.0	千シンガポールドル 130	千シンガポールドル 140	千円 12,246	2018/ 9/ 1
小計	—	—	—	—	118,263	—
(マレーシア)						
3.314% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.314	千マレーシア リンギット 250	千マレーシア リンギット 249	千円 8,112	2017/10/31
3.394% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.394	570	570	18,522	2017/ 3/15
3.48% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.48	300	292	9,510	2023/ 3/15
3.492% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.492	410	407	13,230	2020/ 3/31
3.502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	406	13,195	2027/ 5/31
3.58% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.58	550	552	17,931	2018/ 9/28
3.889% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.889	300	302	9,822	2020/ 7/31
4.012% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.012	70	71	2,308	2017/ 9/15
4.048% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	250	253	8,230	2021/ 9/30
4.16% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	330	337	10,960	2021/ 7/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	160	163	5,301	2024/ 7/15
4.24% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.24	440	450	14,614	2018/ 2/ 7
4.262% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.262	250	253	8,229	2016/ 9/15
4.378% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.378	210	217	7,047	2019/11/29
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	130	135	4,393	2030/ 4/15
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	190	6,181	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	157,592	—
(南アフリカ)						
10.5% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	10.5	千南アフリカランド 2,670	千南アフリカランド 3,189	千円 31,603	2026/12/21
6.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.25	1,510	1,181	11,712	2036/ 3/31
6.50% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.5	2,760	2,186	21,665	2041/ 2/28
6.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.75	3,580	3,452	34,214	2021/ 3/31
7.00% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.0	1,840	1,621	16,069	2031/ 2/28
7.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.25	30	29	295	2020/ 1/15
7.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.75	360	360	3,572	2023/ 2/28
8.00% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.0	2,980	3,053	30,261	2018/12/21
8.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.25	920	946	9,375	2017/ 9/15
8.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	890	909	9,011	2048/ 2/28
小計	—	—	—	—	167,782	—
合計	—	—	—	—	31,573,706	—

(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り捨て。

(注3) 一印は組み入れなし。

■投資信託財産の構成(2015年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 31,573,706	% 98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	389,804	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	31,963,510	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建て純資産(31,952,963千円)の投資信託財産総額(31,963,510千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、3月31日における邦貨換算レートは1米ドル=120.17円、1カナダドル=94.78円、1メキシコペソ=7.89円、1ユーロ=130.32円、1英ポンド=178.07円、1スイスフラン=124.44円、1スウェーデンクローナ=13.99円、1ノルウェークローネ=15.02円、1デンマーククローネ=17.44円、1ポーランドズロチ=31.91円、1オーストラリアドル=92.06円、1シンガポールドル=87.35円、1マレーシアリンギット=32.46円、1南アフリカランド=9.91円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2015年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	31,963,510,527円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	98,208,229
公 社 債(評価額)	31,573,706,890
未 収 利 息	282,833,306
前 払 費 用	8,762,102
(B) 負 債	5,000,000
未 払 解 約 金	5,000,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	31,958,510,527
元 本	14,178,396,947
次 期 繰 越 損 益 金	17,780,113,580
(D) 受 益 権 総 口 数	14,178,396,947口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,540円

(注1) 当ファンドの期首元本額は14,005,933,916円、期中追加設定元本額は775,979,902円、期中一部解約元本額は603,516,871円です。

(注2) 元本の内訳

日立外国債券インデックスファンド	6,975,455,462円
日立外国債券特化型ファンドU(為替ヘッジなし)(非課税適格機関投資家専用)	5,192,483,138円
日立バランスファンド(株式50)	878,100,331円
日立バランスファンド(株式70)	815,371,695円
日立バランスファンド(株式30)	316,986,321円

(注3) 1口当たり純資産額は2,2540円です。

■損益の状況

当期(自2014年4月1日 至2015年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	840,070,650円
受 取 利 息	840,070,650
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,843,901,694
売 買 益	4,051,420,492
売 買 損	△ 1,207,518,798
(C) 信 託 報 酬 等	△ 8,464,546
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,675,507,798
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	13,968,358,736
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	847,380,175
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 711,133,129
(H) 計 (D+E+F+G)	17,780,113,580
次 期 繰 越 損 益 金(H)	17,780,113,580

(注1) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 損益の状況の中で(G)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。