



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15期

(決算日 2016年5月16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15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
	期 中 騰落率	期 中 騰落率	期 中 騰落率	期 中 騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
15期(2016年5月16日)	19,281	△6.6	20,537	△6.4	98.8	—	14,022

(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
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2015年 5月15日	円	%		%	%	%
	20,649	—	21,949	—	98.7	—
5月末	21,094	2.2	22,418	2.1	98.7	—
6月末	20,789	0.7	22,089	0.6	98.6	—
7月末	21,024	1.8	22,382	2.0	98.6	—
8月末	20,735	0.4	22,043	0.4	98.7	—
9月末	20,652	0.0	21,974	0.1	98.7	—
10月末	20,711	0.3	21,993	0.2	98.8	—
11月末	20,658	0.0	21,982	0.1	98.6	—
12月末	20,378	△1.3	21,672	△1.3	98.7	—
2016年 1月末	20,686	0.2	22,019	0.3	98.7	—
2月末	19,618	△5.0	20,884	△4.9	98.8	—
3月末	19,963	△3.3	21,260	△3.1	98.7	—
4月末	19,328	△6.4	20,584	△6.2	98.7	—
(期末) 2016年 5月16日	19,281	△6.6	20,537	△6.4	98.8	—

(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。

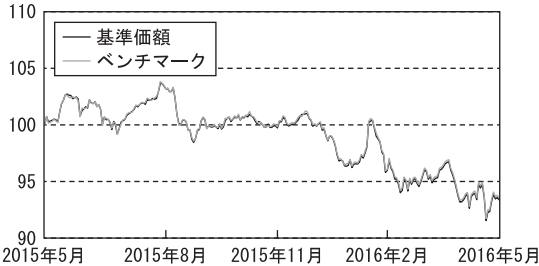
(注3) 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(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

【基準価額の主な変動要因】

〈上昇要因〉

グローバルでの金融緩和と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〉

米国の利上げ観測の後退による円高ドル安の進行がマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2015年5月15日	2015年8月13日	2016年5月2日	2016年5月16日
基準価額	20,649円	21,405円	18,903円	19,281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20,649円から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））とほぼリンクして動き、19,281円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は▲6.6%となり、ベンチマーク騰落率▲6.4%には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低下しプラス影響となりました。また、為替市場では対ドル・対ユーロともに円高が進行したことから為替効果はマイナスとなりました。

米国金利

米国10年国債利回りは、期初2%台前半で始まりましたが、利上げ観測の高まりなどから夏場にかけて2%台半ばまで上昇しました。8月に、中国経済に対する懸念やグローバル市場で株価が下落したこと等を背景に利上げ観測がやや後退し、その後は2%台前半での展開が続きました。米国当局は12月に9年半ぶりの利上げに踏み切りましたが、先行き慎重な姿勢を維持したことから債券市場への影響は限定的でした。年明け後には再び株価が下落したこと、及び日本、欧州当局が追加緩和を実施したこともあり米国長期金利も低下しました。期末にかけては、米国利上げ観測が後退する中で、10年国債利回りは1.7%台での推移が続きました。

ユーロ金利

ユーロ圏の国債利回りは、期初から米国利上げ観測の高まりを契機に、それまでの金利大幅低下の反動もあり、急激に反発して始まりました。しかし、その後はギリシャ債務問題、8月の世界同時株安等を背景に、先行き懸念が高まり低下に転じました。期後半には欧州中央銀行が12月、3月と2度にわたる追加緩和を実施したことで長期金利の低下が加速し、ドイツでは9年国債利回りまでほぼゼロ近傍となっています。イタリア等周縁国とコア国の利回り格差には大きな変化は見られませんでした。

〈外国為替市況〉

ドル円は期初は「アベノミクス」発動以来の円安の流れが継続し、6月には125円台を記録しました。しかし、8月の世界同時株安からリスク選好度が低下するなか円安進行にはブレーキがかかり、その後は120円台前半で推移しました。年明け後、日本銀行はマイナス金利導入に踏み切りましたが、為替市場への影響は一時的に留まる一方、米国当局が利上げに慎重姿勢を示したことから円高が加速し、期末にかけては110円を割り込む水準まで円が買われました。ユーロは、ECBの追加緩和期待を背景に軟調な展開が続きましたが、期末にかけてはECB総裁が一段の追加緩和に否定的な発言をしたことから買い戻し優勢となり、対ドルでほぼ横ばいとなりました。結果として、ユーロ円は円高となりました。

【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、円ベース（為替ヘッジなし））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
	(2015.5.16~2016.5.16)		
	金額	比率	
(a)信託報酬	44円	0.217%	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20,469円です。
(投信会社)	(18)	(0.087)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(16)	(0.076)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(11)	(0.054)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b)その他費用	5	0.025	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)	(5)	(0.025)	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
(その他1)	(0)	(0.000)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	49	0.242	

(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(2015年5月16日から2016年5月16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 468,998	千円 1,051,500	千口 721,783	千円 1,590,000

(注) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2015年5月16日から2016年5月16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
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	163,533	0.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	139,306
2.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	158,099	0.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	120,033
2.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	119,216	0.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	110,351
2.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	104,301	0.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	104,392
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	104,182	0.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	98,663
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	101,563	1.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	98,549
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	100,309	0.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	97,817
3.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	98,794	0.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	91,306
2.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	89,725	1.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	90,418
2.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	87,281	0.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	90,133

(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(2015年5月16日から2016年5月16日まで)

期中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(2016年5月16日現在)

親投資信託残高

項目	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
日立外国債券インデックスマザーファンド	千口 6,908,903	千口 6,656,118	千円 14,005,803

(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(2016年5月16日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日立外国債券インデックスマザーファンド	千円 14,005,803	99.6%
コール・ローン等、その他	56,598	0.4
投資信託財産総額	14,062,401	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(29,787,344千円)の投資信託財産総額(29,844,427千円)に対する比率は99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2016年5月15日における邦貨換算レートは1米ドル=108.83円、1カナダドル=83.98円、1メキシコペソ=5.99円、1ユーロ=123.10円、1英ポンド=156.15円、1スイスフラン=111.54円、1スウェーデンクローナ=13.20円、1ノルウェークローネ=13.28円、1デンマーククローネ=16.55円、1ポーランドズロチ=28.07円、1オーストラリアドル=79.13円、1シンガポールドル=79.28円、1マレーシアリンギット=26.94円、1南アフリカランド=7.05円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2016年5月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	14,062,401,383 円
コール・ローン等	13,497,570
日立外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	14,005,803,813
未 収 入 金	43,100,000
(B) 負 債	39,663,860
未 払 解 約 金	23,537,437
未 払 信 託 報 酬	16,124,875
そ の 他 未 払 費 用	1,548
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	14,022,737,523
元 本	7,272,809,144
次 期 繰 越 損 益 金	6,749,928,379
(D) 受 益 権 総 口 数	7,272,809,144 口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	19,281 円

(注1) 当ファンドの期首元本額は7,532,663,726円、期中追加設定元本額は1,023,843,625円、期中一部解約元本額は1,283,698,207円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,9281円です。

■損益の状況

当期(自2015年5月16日 至2016年5月16日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,512 円
受 取 利 息	1,722
支 払 利 息	△210
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△949,725,878
売 買 益	56,857,974
売 買 損	△1,006,583,852
(C) 信 託 報 酬 等	△33,126,210
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△982,850,576
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,260,947,648
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,471,831,307
(配 当 等 相 当 額)	(4,019,442,185)
(売 買 損 益 相 当 額)	(452,389,122)
(G) 計 (D+E+F)	6,749,928,379
次 期 繰 越 損 益 金(G)	6,749,928,379
追 加 信 託 差 損 益 金	4,471,831,307
(配 当 等 相 当 額)	(4,019,442,185)
(売 買 損 益 相 当 額)	(452,389,122)
分 配 準 備 積 立 金	3,260,947,648
繰 越 損 益 金	△982,850,576

(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(4,019,442,185円)および分配準備積立金(3,260,947,648円)より分配対象収益は7,280,389,833円(10,000口当たり10,010円)ですが、当期に分配した金額はありません。

<お知らせ>

2016年5月17日付で信託報酬率を年率0.216% (税抜0.20%) から年率0.1836% (税抜0.17%) に引き下げる約款変更を行います。

<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(2016年5月16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(14,162,835千口)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	2016年5月16日現在							
	額面金額	評 価 額		組入 比率	う ち B B 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 109,780	千米ドル 115,902	千円 12,613,702	% 42.3	% —	% 17.9	% 16.3	% 8.1
カナダ	千カナダドル 6,280	千カナダドル 7,231	607,271	2.0	—	1.0	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 41,270	千メキシコペソ 45,595	273,114	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	14,570	17,842	2,196,398	7.4	—	4.6	2.0	0.8
イ タ リ ア	19,870	23,773	2,926,477	9.8	—	6.1	2.6	1.1
フ ラ ン ス	19,500	23,700	2,917,585	9.8	—	6.0	3.2	0.6
オ ラ ン ダ	4,690	5,777	711,237	2.4	—	1.5	0.6	0.2
ス ペ イ ン	11,090	13,192	1,624,032	5.4	—	3.1	1.8	0.6
バ ル ギ ー	4,930	6,258	770,464	2.6	—	1.9	0.4	0.2
オーストリア	2,970	3,730	459,277	1.5	—	1.1	0.4	0.1
フィンランド	1,280	1,485	182,852	0.6	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	1,670	1,994	245,539	0.8	—	0.4	0.4	0.1
イギリス	千英ポンド 12,170	千英ポンド 14,991	2,340,960	7.9	—	5.6	1.8	0.4
スイス	千スイスフラン 630	千スイスフラン 753	84,043	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 9,380	千スウェーデンクローナ 11,150	147,191	0.5	—	0.2	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 6,170	千ノルウェークローネ 6,696	88,935	0.3	—	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 9,150	千デンマーククローネ 12,143	200,972	0.7	—	0.5	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 5,880	千ポーランドズロチ 6,289	176,534	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 6,000	千オーストラリアドル 6,758	534,789	1.8	—	1.2	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 1,260	千シンガポールドル 1,347	106,801	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 5,090	千マレーシアリンギット 5,128	138,161	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 20,680	千南アフリカランド 18,119	127,741	0.4	—	0.3	0.1	0.0
合 計	—	—	29,474,085	98.9	—	53.3	32.0	13.7

(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) 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)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
0.5% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	410	409	44,533	2017/ 7/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	520	519	56,578	2017/ 6/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	720	719	78,320	2017/ 7/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	820	819	89,170	2017/ 8/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,190	1,188	129,376	2017/ 9/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	830	828	90,194	2017/11/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	880	877	95,508	2018/ 4/30
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	730	730	79,545	2017/ 6/30
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	390	390	42,466	2017/10/31
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	690	690	75,116	2017/12/31
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	1,180	1,180	128,419	2018/ 2/28
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	460	460	50,061	2018/ 3/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	550	551	60,006	2017/ 7/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	670	671	73,098	2017/ 8/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	720	721	78,547	2017/10/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	660	661	71,990	2017/11/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	660	661	72,001	2017/11/30
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	500	501	54,538	2018/ 1/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	450	451	49,088	2018/ 1/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	440	440	47,948	2018/ 7/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	150	150	16,341	2018/10/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	340	339	36,941	2019/ 7/31
1% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	690	692	75,397	2017/ 9/15
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	210	210	22,918	2019/ 6/30
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	600	602	65,583	2018/ 2/15
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	200	200	21,859	2018/ 5/15
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	640	642	69,955	2018/ 5/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	400	401	43,715	2018/ 8/15
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	660	662	72,136	2018/ 9/15
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	600	601	65,512	2019/ 3/15
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	300	300	32,700	2019/ 8/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	400	400	43,600	2019/ 9/30
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	370	370	40,270	2019/11/30
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	630	632	68,868	2018/ 3/15
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	400	402	43,841	2018/ 6/15
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	290	291	31,777	2019/ 5/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	450	451	49,118	2020/ 3/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	660	661	71,973	2020/ 4/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	670	676	73,662	2018/11/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	630	636	69,275	2019/ 1/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	80	80	8,800	2019/ 4/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	330	333	36,253	2019/10/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	800	806	87,737	2020/ 1/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	690	695	75,650	2020/ 2/29
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	70	70	7,694	2018/10/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	590	596	64,866	2018/11/15
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	500	500	54,512	2021/ 3/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	400	405	44,082	2018/ 6/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	708	77,145	2018/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	790	800	87,083	2018/ 9/30

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	
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	400	405	44,127	2018/11/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	510	516	56,257	2018/12/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	530	537	58,477	2019/ 2/28
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	420	425	46,294	2020/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	810	819	89,185	2020/ 3/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	620	627	68,238	2020/ 4/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	630	637	69,339	2020/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	840	847	92,267	2020/ 9/30
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	870	884	96,220	2018/ 8/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	300	305	33,230	2019/ 3/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	610	66,471	2019/ 5/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	610	620	67,522	2019/11/30
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	500	507	55,265	2020/ 5/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	790	803	87,419	2018/12/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	690	701	76,371	2019/ 1/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	340	345	37,643	2019/ 2/28
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	330	335	36,536	2019/10/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	720	720	78,412	2023/ 2/28
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	550	550	59,861	2023/ 3/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	510	520	56,669	2019/ 3/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	510	520	56,682	2019/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	480	490	53,381	2019/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	674	73,393	2019/ 7/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	550	561	61,161	2019/ 8/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	500	510	55,584	2019/12/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	840	857	93,274	2020/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	640	648	70,538	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	670	677	73,713	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	920	912	99,270	2026/ 2/15
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	480	491	53,438	2018/10/31
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	490	502	54,697	2019/ 9/30
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	470	480	52,269	2022/ 2/28
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	720	735	80,022	2022/ 3/31
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	340	347	37,776	2022/ 4/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	720	738	80,341	2020/10/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	340	347	37,768	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,130	1,149	125,091	2023/ 5/15
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	700	710	77,335	2017/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	650	660	71,872	2017/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	540	549	59,750	2017/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	260	268	29,175	2020/ 6/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	530	546	59,423	2021/11/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	480	492	53,625	2022/ 8/31
2% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	746	81,234	2021/ 8/31
2.0% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,080	1,116	121,512	2023/ 2/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	630	652	71,005	2020/ 7/31
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	520	538	58,656	2020/ 9/30
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	600	621	67,675	2020/11/30
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	746	81,253	2021/ 2/28
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	670	695	75,639	2021/ 5/31
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	746	81,222	2021/10/31
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	902	98,173	2021/11/15

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	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	780	808	87,991	2022/ 2/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,350	1,387	150,983	2025/ 2/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	990	1,015	110,561	2025/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	680	707	77,045	2020/ 8/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	570	594	64,664	2021/ 1/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	690	719	78,348	2021/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	1,022	111,277	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	700	730	79,460	2021/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	820	855	93,130	2021/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	646	70,310	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	420	437	47,601	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	520	539	58,704	2025/ 5/15
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	510	534	58,217	2021/ 3/31
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	660	692	75,363	2021/ 4/30
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	730	766	83,380	2021/ 7/31
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,270	1,331	144,919	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	670	685	74,630	2017/11/30
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	270	278	30,318	2018/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	630	659	71,808	2025/11/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	610	622	67,755	2017/ 7/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	380	392	42,709	2018/ 5/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	570	589	64,131	2018/ 6/30
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	600	631	68,777	2020/12/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,370	1,450	157,821	2024/ 8/15
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	570	581	63,327	2017/ 6/30
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,110	1,186	129,078	2024/ 5/15
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	570	563	61,291	2045/ 2/15
2.50% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	930	993	108,114	2023/ 8/15
2.50% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	270	266	29,023	2046/ 2/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	220	227	24,709	2018/ 1/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	820	870	94,755	2020/ 8/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,150	1,223	133,103	2020/11/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	510	526	57,307	2017/12/31
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	450	466	50,729	2018/ 2/28
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,090	1,184	128,958	2024/ 2/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	490	514	55,951	2042/ 8/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	523	56,991	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	410	431	46,921	2019/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,210	1,314	143,103	2023/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	480	499	54,323	2018/ 3/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	570	609	66,385	2043/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	810	863	94,019	2045/ 8/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	170	187	20,356	2042/ 5/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	700	765	83,358	2044/11/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	770	841	91,609	2045/ 5/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	540	590	64,250	2045/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	560	596	64,958	2019/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	930	1,015	110,487	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	304	33,116	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	417	45,391	2042/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	230	258	28,128	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	640	717	78,074	2044/ 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	
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	780	844	91,917	2019/11/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	900	1,057	115,049	2044/ 5/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	290	303	33,062	2018/ 2/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	840	919	100,030	2020/ 5/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	40	48	5,252	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	580	630	68,575	2019/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	750	821	89,440	2020/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,150	1,278	139,156	2021/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	780	959	104,464	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	960	1,180	128,433	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	510	547	59,531	2018/11/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	90	112	12,222	2041/ 8/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	930	1,170	127,392	2043/11/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	350	371	40,477	2018/ 5/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	40	50	5,530	2040/ 8/15
4.00% US TREASURY N/B	国債証券	4.0	300	322	35,064	2018/ 8/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	490	515	56,138	2017/11/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	220	295	32,105	2039/ 5/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	290	389	42,355	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	250	340	37,095	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	680	927	100,935	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	320	437	47,656	2041/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	41	4,539	2038/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	450	624	67,969	2039/ 8/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	230	319	34,730	2036/ 2/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	400	564	61,417	2040/ 2/15
4.75% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	490	705	76,740	2041/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	350	367	40,039	2017/ 8/15
5.00% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	130	192	20,927	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	170	233	25,443	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	165	18,024	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	230	331	36,060	2031/ 2/15
5.50% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	167	18,255	2028/ 8/15
6.00% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	140	194	21,173	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	130	188	20,475	2027/11/15
6.25% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	265	28,901	2023/ 8/15
6.25% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	150	229	25,007	2030/ 5/15
6.50% US TREASURY N/B	国債証券	6.5	90	131	14,278	2026/11/15
8.00% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	260	352	38,389	2021/11/15
8.125% US TREASURY N/B	国債証券	8.125	140	172	18,733	2019/ 8/15
8.75% US TREASURY N/B	国債証券	8.75	210	276	30,092	2020/ 8/15
8.875% US TREASURY N/B	国債証券	8.875	40	48	5,306	2019/ 2/15
小計	—	—	—	—	12,613,702	—
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
0.25% CANADA GOV' T	国債証券	0.25	200	199	16,748	2017/ 5/ 1
0.25% CANADA GOV' T	国債証券	0.25	120	119	10,032	2017/11/ 1
0.75% CANADA GOV' T	国債証券	0.75	90	90	7,584	2021/ 3/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	460	463	38,954	2017/ 8/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	180	182	15,294	2018/ 2/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	120	121	10,203	2018/ 3/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	140	142	11,945	2018/ 9/ 1
1.5 % CANADA GOV' T	国債証券	1.5	370	382	32,120	2020/ 3/ 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	
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	260	263	22,099	2017/ 9/ 1
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	310	321	26,994	2023/ 6/ 1
1.75% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	380	394	33,123	2019/ 9/ 1
1.75% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	200	206	17,349	2019/ 3/ 1
2.25% CANADA GOV' T	国債証券	2.25	160	174	14,679	2025/ 6/ 1
2.50% CANADA GOV' T	国債証券	2.5	200	221	18,643	2024/ 6/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	190	211	17,747	2022/ 6/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	60	71	5,970	2048/12/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	120	150	12,666	2064/12/ 1
3.25% CANADA GOV' T	国債証券	3.25	310	349	29,316	2021/ 6/ 1
3.50% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	220	245	20,595	2020/ 6/ 1
3.50% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	200	269	22,607	2045/12/ 1
3.75% CANADA GOV' T	国債証券	3.75	350	383	32,191	2019/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	280	290	24,354	2017/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	290	405	34,083	2041/ 6/ 1
4.25% CANADA GOV' T	国債証券	4.25	170	182	15,346	2018/ 6/ 1
5.00% CANADA GOV' T	国債証券	5.0	330	503	42,317	2037/ 6/ 1
5.75% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	270	402	33,771	2029/ 6/ 1
5.75% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	200	314	26,451	2033/ 6/ 1
8.00% CANADA GOV' T	国債証券	8.0	100	167	14,078	2027/ 6/ 1
小計	—	—	—	—	607,271	—
(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	5,140	5,163	30,930	2018/ 6/14
5.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.0	2,050	2,070	12,402	2017/ 6/15
5.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.0	800	798	4,780	2019/12/11
6.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	900	943	5,650	2022/ 6/ 9
7.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	3,100	3,453	20,687	2027/ 6/ 3
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	3,690	3,898	23,349	2017/12/14
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,622	15,708	2031/ 5/29
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	900	1,020	6,115	2034/11/23
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	4,180	4,777	28,618	2042/11/13
8.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,240	4,679	28,031	2020/ 6/11
8.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	3,040	3,463	20,748	2023/12/ 7
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	4,360	4,758	28,503	2018/12/13
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	2,980	3,580	21,447	2029/ 5/31
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	4,363	26,140	2038/11/18
小計	—	—	—	—	273,114	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	370	376	46,394	2020/ 4/17
0.25% BUNDESOBL	国債証券	0.25	200	206	25,370	2020/10/16
0.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	410	416	51,212	2018/ 4/13
0.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	300	307	37,886	2019/10/11
0.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	410	428	52,716	2025/ 2/15
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	160	162	19,975	2017/10/13
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	410	417	51,379	2018/ 2/23
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	120	124	15,299	2026/ 2/15
1% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	300	326	40,220	2024/ 8/15
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	330	342	42,126	2018/10/12
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	360	375	46,208	2019/ 2/22
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	480	521	64,216	2025/ 8/15
1.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	220	248	30,594	2024/ 5/15
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	440	489	60,317	2022/ 9/ 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	
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	320	357	44,063	2023/ 2/15
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	330	370	45,558	2023/ 5/15
1.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	480	540	66,574	2022/ 7/ 4
1.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	420	482	59,343	2024/ 2/15
2.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	360	407	50,196	2022/ 1/ 4
2.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	360	417	51,450	2023/ 8/15
2.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	300	335	41,295	2020/ 9/ 4
2.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	370	421	51,941	2021/ 9/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	390	443	54,581	2021/ 1/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	250	356	43,851	2044/ 7/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	240	346	42,617	2046/ 8/15
3.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.0	430	492	60,587	2020/ 7/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	360	409	50,413	2020/ 1/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	170	202	24,867	2021/ 7/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	190	300	37,006	2042/ 7/ 4
3.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.5	460	518	63,789	2019/ 7/ 4
3.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.75	430	478	58,940	2019/ 1/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	440	472	58,193	2018/ 1/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	430	707	87,080	2037/ 1/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	400	421	51,903	2017/ 7/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	580	639	78,702	2018/ 7/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	260	455	56,074	2039/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	270	416	51,244	2028/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	240	413	50,907	2034/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	330	622	76,590	2040/ 7/ 4
5.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	260	448	55,155	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	330	536	66,016	2028/ 1/ 4
6.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	250	373	45,990	2024/ 1/ 4
6.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	140	251	30,957	2030/ 1/ 4
6.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	270	459	56,582	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.25	360	362	44,564	2018/ 5/15
0.70% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.7	100	101	12,526	2020/ 5/ 1
0.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.75	380	385	47,400	2018/ 1/15
0.95% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	130	130	16,033	2023/ 3/15
1.05% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.05	340	350	43,180	2019/12/ 1
1.35% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	350	363	44,692	2022/ 4/15
1.45% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	50	51	6,399	2022/ 9/15
1.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	370	386	47,569	2019/ 8/ 1
1.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	420	424	52,203	2025/ 6/ 1
1.65% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	352	43,360	2032/ 3/ 1
2.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	190	198	24,469	2025/12/ 1
2.15% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	230	249	30,694	2021/12/15
2.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	220	240	29,652	2024/12/ 1
2.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	450	481	59,333	2019/ 5/ 1
2.70% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	210	210	25,887	2047/ 3/ 1
3.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	180	201	24,828	2046/ 9/ 1
3.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	200	237	29,292	2030/ 3/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	200	210	25,900	2017/11/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	330	353	43,531	2018/ 6/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	400	435	53,597	2018/12/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	470	543	66,957	2021/ 3/ 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	
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	734	90,419	2021/ 8/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	370	441	54,337	2024/ 9/ 1
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	470	543	66,934	2020/ 9/ 1
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	530	669	82,375	2037/ 2/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	270	300	37,039	2019/ 2/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	544	67,064	2019/ 9/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	430	495	61,037	2020/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	490	528	65,005	2018/ 2/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	550	604	74,441	2018/ 8/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	520	584	71,968	2019/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	460	533	65,663	2020/ 2/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	290	359	44,263	2023/ 5/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	520	648	79,835	2024/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	320	406	50,082	2026/ 3/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	200	209	25,769	2017/ 5/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	370	388	47,847	2017/ 6/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	350	426	52,542	2021/ 9/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	480	605	74,592	2023/ 8/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	170	224	27,632	2028/ 9/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	290	410	50,585	2044/ 9/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	460	572	70,488	2022/ 3/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	440	571	70,402	2025/ 3/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	460	647	79,723	2034/ 8/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	350	503	61,943	2039/ 8/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	360	516	63,602	2040/ 9/ 1
5.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	580	617	76,017	2017/ 8/ 1
5.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	570	794	97,833	2029/11/ 1
5.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	410	528	65,041	2022/ 9/ 1
5.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	390	503	62,027	2022/11/ 1
5.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	310	465	57,321	2033/ 2/ 1
6.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	570	860	105,896	2031/ 5/ 1
6.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	510	760	93,587	2027/11/ 1
7.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	220	339	41,787	2026/11/ 1
9.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	156	19,289	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	—	270	272	33,599	2019/ 2/25
0% FRANCE GOV' T	国債証券	—	500	505	62,282	2020/ 5/25
0% FRANCE GOV' T	国債証券	—	220	221	27,323	2021/ 5/25
0.00% FRANCE GOV' T	国債証券	—	30	30	3,722	2018/ 2/25
0.25% FRANCE GOV' T	国債証券	0.25	310	316	39,004	2020/11/25
0.5% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	500	514	63,390	2019/11/25
0.5% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	600	609	74,997	2025/ 5/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	410	417	51,359	2017/ 7/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	530	545	67,141	2018/ 5/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	490	507	62,484	2018/11/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	340	354	43,620	2019/ 5/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	550	580	71,503	2025/11/25
1.25% FRANCE GOV' T	国債証券	1.25	200	200	24,659	2036/ 5/25
1.50% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	140	150	18,566	2031/ 5/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	580	650	80,072	2023/ 5/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	530	597	73,541	2024/11/25
2.25% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	540	619	76,298	2022/10/25

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	
2.25% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	510	594	73,221	2024/ 5/25
2.5% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	610	742	91,415	2030/ 5/25
2.50% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	680	763	94,037	2020/10/25
2.75% FRANCE GOV' T	国債証券	2.75	610	753	92,797	2027/10/25
3.00% FRANCE GOV' T	国債証券	3.0	470	556	68,554	2022/ 4/25
3.25% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	610	723	89,057	2021/10/25
3.25% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	150	213	26,303	2045/ 5/25
3.50% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	650	748	92,113	2020/ 4/25
3.50% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	680	883	108,795	2026/ 4/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	800	914	112,513	2019/10/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	690	825	101,646	2021/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	610	662	81,601	2018/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	440	674	83,006	2038/10/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	340	573	70,578	2055/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	290	496	61,073	2060/ 4/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	400	427	52,608	2017/10/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	550	613	75,484	2018/10/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	650	739	91,025	2019/ 4/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	690	905	111,431	2023/10/25
4.50% FRANCE GOV' T	国債証券	4.5	370	619	76,241	2041/ 4/25
4.75% FRANCE GOV' T	国債証券	4.75	440	714	87,929	2035/ 4/25
5.50% FRANCE GOV' T	国債証券	5.5	510	811	99,897	2029/ 4/25
5.75% FRANCE GOV' T	国債証券	5.75	540	934	115,086	2032/10/25
6.00% FRANCE GOV' T	国債証券	6.0	220	336	41,411	2025/10/25
8.50% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	80	104	12,875	2019/10/25
8.50% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	170	270	33,311	2023/ 4/25
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.25	60	60	7,405	2025/ 7/15
0.25% NETHERLANDS GOV' TT	国債証券	0.25	240	246	30,291	2020/ 1/15
1.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	1.25	240	246	30,400	2018/ 1/15
1.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	1.25	200	209	25,754	2019/ 1/15
1.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	1.75	460	519	63,959	2023/ 7/15
2.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.0	110	127	15,660	2024/ 7/15
2.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.25	310	356	43,885	2022/ 7/15
2.50% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.5	320	411	50,650	2033/ 1/15
2.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.75	140	205	25,320	2047/ 1/15
3.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.25	280	331	40,792	2021/ 7/15
3.50% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.5	320	372	45,832	2020/ 7/15
3.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	270	340	41,855	2023/ 1/15
3.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	260	431	53,139	2042/ 1/15
4.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	300	329	40,526	2018/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	270	308	37,959	2019/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	310	500	61,660	2037/ 1/15
4.50% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.5	310	328	40,381	2017/ 7/15
5.5% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	5.5	210	332	40,883	2028/ 1/15
7.50% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	7.5	80	120	14,877	2023/ 1/15
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.25% SPANISH GOV' T	国債証券	0.25	210	211	26,006	2018/ 4/30
0.5% SPANISH GOV' T	国債証券	0.5	390	393	48,417	2017/10/31
1.15% SPANISH GOV' T	国債証券	1.15	110	113	13,982	2020/ 7/30
1.4% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	280	291	35,936	2020/ 1/31
1.6% SPANISH GOV' T	国債証券	1.6	420	425	52,399	2025/ 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	
1.95% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	270	266	32,748	2030/ 7/30
2.10% SPANISH GOV' T	国債証券	2.1	30	30	3,772	2017/ 4/30
2.15% SPANISH GOV' T	国債証券	2.15	140	147	18,162	2025/10/31
2.75% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	390	420	51,777	2019/ 4/30
2.75% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	430	476	58,676	2024/10/31
3.75% SPANISH GOV' T	国債証券	3.75	420	458	56,494	2018/10/31
3.80% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	470	558	68,809	2024/ 4/30
4.00% SPANISH GOV' T	国債証券	4.0	480	549	67,620	2020/ 4/30
4.10% SPANISH GOV' T	国債証券	4.1	480	523	64,494	2018/ 7/30
4.20% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	340	431	53,142	2037/ 1/31
4.30% SPANISH GOV' T	国債証券	4.3	340	388	47,776	2019/10/31
4.40% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	360	444	54,734	2023/10/31
4.50% SPANISH GOV' T	国債証券	4.5	400	431	53,080	2018/ 1/31
4.60% SPANISH GOV' T	国債証券	4.6	470	536	66,090	2019/ 7/30
4.65% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	340	432	53,183	2025/ 7/30
4.70% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	270	368	45,385	2041/ 7/30
4.80% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	340	430	53,012	2024/ 1/31
4.85% SPANISH GOV' T	国債証券	4.85	400	477	58,836	2020/10/31
4.90% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	260	363	44,757	2040/ 7/30
5.15% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	330	446	55,003	2028/10/31
5.15% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	240	351	43,302	2044/10/31
5.40% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	360	465	57,247	2023/ 1/31
5.50% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	450	480	59,150	2017/ 7/30
5.50% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	390	485	59,727	2021/ 4/30
5.75% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	410	609	75,040	2032/ 7/30
5.85% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	410	529	65,188	2022/ 1/31
5.90% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	330	461	56,762	2026/ 7/30
6.00% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	189	23,311	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	310	321	39,614	2025/ 6/22
1.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	70	73	9,021	2026/ 6/22
1.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	90	90	11,093	2031/ 6/22
1.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	260	269	33,171	2018/ 6/22
1.60% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6	60	60	7,409	2047/ 6/22
2.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	290	335	41,335	2023/ 6/22
2.60% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	300	357	44,027	2024/ 6/22
3.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	130	144	17,846	2019/ 9/28
3.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	70	91	11,273	2034/ 6/22
3.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.5	150	156	19,290	2017/ 6/28
3.75% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	300	353	43,536	2020/ 9/28
3.75% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	150	231	28,450	2045/ 6/22
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	200	216	26,688	2018/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	210	237	29,183	2019/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	310	386	47,518	2022/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	170	245	30,237	2032/ 3/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	270	334	41,227	2021/ 9/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	260	332	40,881	2022/ 9/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	270	435	53,641	2041/ 3/28
4.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	200	279	34,389	2026/ 3/28
5.0% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	370	614	75,594	2035/ 3/28
5.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	150	162	19,982	2017/ 9/28
5.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	340	528	65,049	2028/ 3/28

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	
1.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.15	240	249	30,690	2018/10/19
1.2% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	70	75	9,308	2025/10/20
1.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	170	191	23,534	2024/10/21
1.75% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	240	271	33,393	2023/10/20
3.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	110	159	19,688	2044/ 6/20
3.40% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	220	270	33,297	2022/11/22
3.50% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	320	383	47,262	2021/ 9/15
3.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	150	184	22,656	2022/ 4/20
3.80% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	88	10,866	2062/ 1/26
3.90% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.9	240	282	34,817	2020/ 7/15
4.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	280	440	54,283	2037/ 3/15
4.30% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.3	170	180	22,260	2017/ 9/15
4.35% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.35	290	329	40,543	2019/ 3/15
4.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.65	50	54	6,682	2018/ 1/15
4.85% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	258	31,781	2026/ 3/15
6.25% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	190	310	38,210	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	41	5,065	2020/ 9/15
0.75% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	60	59	7,331	2031/ 4/15
0.875%FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	60	63	7,756	2025/ 9/15
1.50% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	110	121	14,953	2023/ 4/15
1.625%FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	100	110	13,644	2022/ 9/15
2.00% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	90	103	12,716	2024/ 4/15
2.625%FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	70	95	11,806	2042/ 7/ 4
2.75% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	120	150	18,521	2028/ 7/ 4
3.375%FINNISH GOV' T	国債証券	3.375	110	126	15,516	2020/ 4/15
3.50% FINNISH GOV' T	国債証券	3.5	160	189	23,331	2021/ 4/15
3.875%FINNISH GOV' T	国債証券	3.875	100	105	13,028	2017/ 9/15
4.00% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	100	133	16,492	2025/ 7/ 4
4.375%FINNISH GOV' T	国債証券	4.375	160	184	22,687	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	140	146	18,028	2045/ 2/18
2.40% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	120	137	16,959	2030/ 5/15
3.40% IRISH GOV' T 2024	国債証券	3.4	140	170	20,973	2024/ 3/18
3.90% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	80	99	12,205	2023/ 3/20
4.40% IRISH GOV' T	国債証券	4.4	270	308	38,016	2019/ 6/18
4.50% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	40	44	5,500	2018/10/18
4.50% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	50	59	7,265	2020/ 4/18
5.00% IRISH GOV' T	国債証券	5.0	160	195	24,080	2020/10/18
5.40% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	240	335	41,332	2025/ 3/13
5.50% IRISH GOV' T	国債証券	5.5	180	195	24,010	2017/10/18
5.90% IRISH GOV' T	国債証券	5.9	250	301	37,166	2019/10/18
小計	—	—	—	—	12,033,866	—
(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	410	413	64,552	2017/ 9/ 7
1.25% UK TREASURY	国債証券	1.25	630	642	100,263	2018/ 7/22
1.50% UK TREASURY	国債証券	1.5	150	149	23,415	2026/ 7/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	500	519	81,065	2019/ 7/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	480	502	78,474	2022/ 9/ 7
2% UK TREASURY	国債証券	2.0	450	474	74,040	2020/ 7/22
2.00% UK TREASURY	国債証券	2.0	330	348	54,343	2025/ 9/ 7
2.25% UK TREASURY	国債証券	2.25	480	517	80,775	2023/ 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	
2.50% UK TREASURY	国債証券	2.5	150	169	26,413	2065/ 7/22
2.75% UK TREASURY	国債証券	2.75	320	357	55,784	2024/ 9/ 7
3.25% UK TREASURY	国債証券	3.25	250	301	47,036	2044/ 1/22
3.5% UK TREASURY	国債証券	3.5	50	63	9,857	2045/ 1/22
3.50% UK TREASURY	国債証券	3.5	370	536	83,716	2068/ 7/22
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	380	420	65,733	2019/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	460	520	81,331	2020/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	440	507	79,197	2021/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	320	450	70,289	2052/ 7/22
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	280	330	51,561	2022/ 3/ 7
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	220	341	53,264	2060/ 1/22
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	250	321	50,139	2027/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	461	72,135	2032/ 6/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	390	60,915	2036/ 3/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	240	329	51,492	2039/ 9/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	340	472	73,706	2040/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	360	521	81,442	2046/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	260	388	60,719	2049/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	330	522	81,627	2055/12/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	390	60,970	2019/ 3/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	481	75,136	2034/ 9/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	390	568	88,783	2042/12/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	380	439	68,676	2020/ 3/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	380	522	81,582	2030/12/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	320	466	72,888	2038/12/ 7
5.00% UK TREASURY	国債証券	5.0	360	390	61,037	2018/ 3/ 7
5.00% UK TREASURY	国債証券	5.0	330	432	67,575	2025/ 3/ 7
6.00% UK TREASURY	国債証券	6.0	190	285	44,645	2028/12/ 7
8.00% UK TREASURY	国債証券	8.0	30	40	6,365	2021/ 6/ 7
小計	—	—	—	—	2,340,960	—
(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	7,633	2021/ 4/28
3.00% SWITZERLAND	国債証券	3.0	150	159	17,796	2018/ 1/ 8
3.00% SWITZERLAND	国債証券	3.0	170	190	21,208	2019/ 5/12
4.00% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	131	14,682	2023/ 2/11
4.00% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	151	16,847	2028/ 4/ 8
4.25% SWITZERLAND	国債証券	4.25	50	52	5,875	2017/ 6/ 5
小計	—	—	—	—	84,043	—
(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	700	760	10,034	2023/11/13
2.50% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	700	823	10,872	2025/ 5/12
3.5% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,520	1,828	24,141	2022/ 6/ 1
3.5% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	1,862	24,586	2039/ 3/30
3.75% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.75	1,120	1,180	15,582	2017/ 8/12
4.25% SWEDEN GOV' T	国債証券	4.25	1,960	2,221	29,318	2019/ 3/12
5.00% SWEDEN GOV' T	国債証券	5.0	2,000	2,474	32,656	2020/12/ 1
小計	—	—	—	—	147,191	—
(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	870	11,555	2025/ 3/13
2.00% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,360	1,442	19,151	2023/ 5/24

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	
(ノルウェー)		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
3.00% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	210	238	3,161	2024/ 3/14
3.75% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,400	1,595	21,185	2021/ 5/25
4.25% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.25	1,030	1,067	14,176	2017/ 5/19
4.50% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.5	1,330	1,483	19,704	2019/ 5/22
小計	—	—	—	—	88,935	—
(デンマーク)		%	千デンマーククロネ	千デンマーククロネ	千円	
1.50% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	1,200	1,322	21,887	2023/11/15
1.75% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	300	337	5,584	2025/11/15
3.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	2,060	2,414	39,963	2021/11/15
4.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,060	1,131	18,725	2017/11/15
4.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,520	1,752	28,997	2019/11/15
4.50% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,450	4,299	71,164	2039/11/15
7.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	7.0	560	885	14,649	2024/11/10
小計	—	—	—	—	200,972	—
(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	—	620	609	17,111	2017/ 7/25
2.00% POLAND GOV' T	国債証券	2.0	420	416	11,698	2021/ 4/25
2.50% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	890	907	25,466	2018/ 7/25
2.50% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	300	287	8,059	2026/ 7/25
3.25% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	170	177	4,996	2019/ 7/25
3.25% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	430	443	12,439	2025/ 7/25
4.00% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	780	849	23,851	2023/10/25
5.25% POLAND GOV' T	国債証券	5.25	460	484	13,609	2017/10/25
5.25% POLAND GOV' T	国債証券	5.25	330	375	10,543	2020/10/25
5.5% POLAND GOV' T	国債証券	5.5	310	348	9,772	2019/10/25
5.75% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	510	600	16,866	2021/10/25
5.75% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	787	22,118	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	176,534	—
(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	
1.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	1.75	110	110	8,714	2020/11/21
2.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	250	259	20,540	2019/10/21
2.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	490	511	40,452	2024/ 4/21
2.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	100	97	7,725	2035/ 6/21
3.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	380	411	32,547	2025/ 4/21
3.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	320	345	27,367	2029/ 4/21
3.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	260	292	23,108	2037/ 4/21
4.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	240	247	19,562	2017/ 7/21
4.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	340	399	31,596	2026/ 4/21
4.50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	540	598	47,370	2020/ 4/15
4.520% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	140	173	13,719	2033/ 4/21
4.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	470	578	45,808	2027/ 4/21
5.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.25	490	539	42,705	2019/ 3/15
5.50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	510	542	42,955	2018/ 1/21
5.50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	310	379	30,000	2023/ 4/21
5.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	320	380	30,112	2021/ 5/15
5.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	730	890	70,502	2022/ 7/15
小計	—	—	—	—	534,789	—
(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	188	14,926	2018/ 4/ 1
2.00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.0	70	71	5,705	2020/ 7/ 1
2.25% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.25	50	51	4,099	2021/ 6/ 1
2.50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.5	60	62	4,949	2019/ 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	
(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	
2.75% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	110	117	9,282	2042/ 4/ 1
3.00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	250	270	21,435	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	60	65	5,158	2022/ 9/ 1
3.25% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.25	100	107	8,544	2020/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	100	114	9,088	2033/ 9/ 1
3.50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	140	159	12,607	2027/ 3/ 1
4.00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	4.0	130	138	11,002	2018/ 9/ 1
小計	—	—	—	—	106,801	—
(マレーシア)		%	千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット	千円	
3.314% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.314	250	251	6,777	2017/10/31
3.48% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.48	300	293	7,918	2023/ 3/15
3.492% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.492	410	410	11,067	2020/ 3/31
3.502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	405	10,934	2027/ 5/31
3.58% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.58	550	555	14,959	2018/ 9/28
3.795% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.795	30	30	809	2022/ 9/30
3.889% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.889	300	305	8,219	2020/ 7/31
3.955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	900	906	24,425	2025/ 9/15
4.012% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.012	70	71	1,914	2017/ 9/15
4.048% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	250	254	6,866	2021/ 9/30
4.16% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	330	338	9,128	2021/ 7/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	310	316	8,518	2024/ 7/15
4.24% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.24	440	449	12,119	2018/ 2/ 7
4.378% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.378	210	217	5,851	2019/11/29
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	130	134	3,617	2030/ 4/15
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	186	5,033	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	138,161	—
(南アフリカ)		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
10.5% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	10.5	2,670	2,902	20,464	2026/12/21
6.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.25	1,510	1,053	7,426	2036/ 3/31
6.50% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.5	3,120	2,155	15,199	2041/ 2/28
6.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.75	3,580	3,305	23,300	2021/ 3/31
7.00% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.0	3,270	2,601	18,341	2031/ 2/28
7.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.25	390	374	2,637	2020/ 1/15
7.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.75	360	338	2,383	2023/ 2/28
8.00% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.0	2,420	2,403	16,941	2018/12/21
8.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.25	100	100	707	2017/ 9/15
8.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.25	920	811	5,724	2032/ 3/31
8.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	450	400	2,821	2044/ 1/31
8.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	1,890	1,672	11,792	2048/ 2/28
小計	—	—	—	—	127,741	—
合計	—	—	—	—	29,474,085	—

(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 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率			
12期(2012年4月 2日)	14,921	5.7	98.7	—	百万円 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
16期(2016年3月31日)	21,780	△3.4	98.7	—	31,196

(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 比率	債券先物 比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2015年 3月31日	22,540	—	23,581	—	98.8	—
4月末	22,577	0.2	23,577	△0.0	99.7	—
5月末	22,974	1.9	24,039	1.9	98.7	—
6月末	22,645	0.5	23,687	0.4	98.7	—
7月末	22,906	1.6	24,000	1.8	98.6	—
8月末	22,595	0.2	23,637	0.2	98.8	—
9月末	22,508	△0.1	23,564	△0.1	98.7	—
10月末	22,577	0.2	23,583	0.0	98.8	—
11月末	22,523	△0.1	23,572	△0.0	98.7	—
12月末	22,222	△1.4	23,239	△1.5	98.8	—
2016年 1月末	22,561	0.1	23,611	0.1	98.7	—
2月末	21,400	△5.1	22,394	△5.0	98.8	—
(期末) 2016年 3月31日	21,780	△3.4	22,798	△3.3	98.7	—

(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
	(2015.4.1~2016.3.31)
	金額
(a)その他費用 (保管費用)	6円 (6)
(その他)	(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(2015年4月1日から2016年3月31日まで)

公社債

			買付額	売付額	
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 41,034	千米ドル 35,293	
		カナダ	国債証券	千カナダドル 2,322	千カナダドル 2,432
		メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 11,713	千メキシコペソ 8,085
	ユーロ	ドイツ	国債証券	千ユーロ 3,716	千ユーロ 4,070
		イタリア	国債証券	3,977	3,612
		フランス	国債証券	4,559	3,468
		オランダ	国債証券	797	1,006
		スペイン	国債証券	3,137	2,291
		ベルギー	国債証券	901	637
		オーストリア	国債証券	442	400
		フィンランド	国債証券	232	193
		アイルランド	国債証券	194	196
	イギリス	国債証券	千英ポンド 1,807	千英ポンド 1,544	
	スイス	国債証券	千スイスフラン 44	千スイスフラン 164	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 1,792	千スウェーデンクローナ 1,269	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 1,130	千ノルウェークローネ 308	
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 1,431	千デンマーククローネ 1,799	
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 1,582	千ポーランドズロチ 1,300	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 1,673	千オーストラリアドル 897	
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 218	千シンガポールドル 242	
マレーシア	国債証券	千マレーシアリングギット 719	千マレーシアリングギット 372		
南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 4,930	千南アフリカランド 2,983		

(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) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2015年4月1日から2016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
2.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	158,099	0.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	120,033
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	139,500	0.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	119,061
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	128,219	0.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	112,087
2.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	119,216	0.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	110,351
2.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	104,301	0.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	104,392
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	104,182	0.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	98,663
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	101,563	1.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	98,549
3.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	98,794	0.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	97,817
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	96,388	3.250% FRANCE GOV' T (ユーロ・フランス)	94,310
1.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	95,090	1.000% US TREASURY N/B(アメリカ)	90,418

(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(2015年4月1日から2016年3月31日まで)

期中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(2016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 B B 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 110,980	千米ドル 116,619	千円 13,140,722	% 42.1	% —	% 17.3	% 16.0	% 8.9
カナダ	千カナダドル 6,270	千カナダドル 7,240	628,368	2.0	—	1.0	0.5	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 41,330	千メキシコペソ 45,371	296,274	0.9	—	0.5	0.3	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	14,890	18,178	2,321,419	7.4	—	4.7	1.9	0.8
イ タ リ ア	19,620	23,974	3,061,564	9.8	—	6.1	2.7	1.0
フ ラ ン ス	19,670	24,043	3,070,378	9.8	—	6.2	3.0	0.6
オ ラ ン ダ	4,890	5,991	765,105	2.5	—	1.5	0.6	0.3
ス ペ イ ン	11,100	13,300	1,698,426	5.4	—	3.2	1.6	0.6
ベルギー	5,070	6,456	824,527	2.6	—	1.9	0.4	0.3
オーストリア	3,040	3,816	487,382	1.6	—	1.1	0.4	0.1
フィンランド	1,350	1,549	197,874	0.6	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	1,670	2,007	256,379	0.8	—	0.4	0.4	0.1
イギリス	千英ポンド 12,060	千英ポンド 14,785	2,393,998	7.7	—	5.5	1.7	0.5
スイス	千スイスフラン 630	千スイスフラン 757	88,403	0.3	—	0.1	0.1	0.1
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 10,726	148,568	0.5	—	0.2	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 5,670	千ノルウェークローネ 6,216	84,300	0.3	—	0.2	0.0	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 9,150	千デンマーククローネ 12,140	208,092	0.7	—	0.5	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 5,610	千ポーランドズロチ 6,070	181,139	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 5,780	千オーストラリアドル 6,425	554,178	1.8	—	1.1	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 1,280	千シンガポールドル 1,362	113,550	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 5,180	千マレーシアリンギット 5,218	149,562	0.5	—	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 19,870	千南アフリカランド 17,335	130,709	0.4	—	0.4	0.1	0.0
合 計	—	—	30,800,926	98.7	—	53.0	31.0	14.7

(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)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
0.5% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	410	408	46,079	2017/ 7/31
0.50% US TREASURY N/B	国債証券	0.5	680	678	76,472	2017/ 4/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,280	1,278	144,106	2017/ 5/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	520	519	58,543	2017/ 6/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	720	719	81,040	2017/ 7/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	820	818	92,260	2017/ 8/31
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	1,190	1,188	133,869	2017/ 9/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	770	768	86,587	2017/11/30
0.625% US TREASURY N/B	国債証券	0.625	880	876	98,794	2018/ 4/30
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	730	730	82,327	2017/ 6/30
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	390	390	43,945	2017/10/31
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	690	689	77,737	2017/12/31
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	1,180	1,179	132,910	2018/ 2/28
0.75% US TREASURY N/B	国債証券	0.75	460	459	51,808	2018/ 3/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	830	831	93,736	2017/ 4/30
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	720	721	81,300	2017/ 5/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	740	741	83,565	2017/ 6/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	550	551	62,104	2017/ 7/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	670	671	75,654	2017/ 8/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	720	721	81,294	2017/10/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	270	270	30,487	2017/11/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	660	661	74,519	2017/11/30
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	500	500	56,450	2018/ 1/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	450	450	50,808	2018/ 1/31
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	440	440	49,633	2018/ 7/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	150	150	16,909	2018/10/15
0.875% US TREASURY N/B	国債証券	0.875	340	338	38,170	2019/ 7/31
1% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	690	692	78,040	2017/ 9/15
1.0% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	340	340	38,362	2019/ 6/30
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	600	602	67,887	2018/ 2/15
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	640	642	72,402	2018/ 5/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	660	662	74,647	2018/ 9/15
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	300	299	33,801	2019/ 8/31
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	400	399	45,040	2019/ 9/30
1.00% US TREASURY N/B	国債証券	1.0	370	369	41,610	2019/11/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	290	291	32,850	2019/ 5/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	450	450	50,713	2020/ 3/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	660	659	74,333	2020/ 4/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	670	676	76,256	2018/11/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	630	636	71,714	2019/ 1/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	80	80	9,100	2019/ 4/30
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	330	332	37,437	2019/10/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	800	804	90,608	2020/ 1/31
1.25% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	690	693	78,131	2020/ 2/29
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	70	70	7,965	2018/10/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	590	595	67,125	2018/11/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	708	79,861	2018/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	790	800	90,199	2018/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	400	405	45,684	2018/11/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	510	517	58,256	2018/12/31

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	
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	530	537	60,532	2019/ 2/28
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	720	727	81,940	2020/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	810	817	92,097	2020/ 3/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	620	625	70,456	2020/ 4/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	630	635	71,576	2020/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	840	845	95,242	2020/ 9/30
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	870	883	99,593	2018/ 8/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	300	305	34,392	2019/ 3/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	700	711	80,182	2019/ 5/31
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	610	619	69,781	2019/11/30
1.5% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	500	506	57,079	2020/ 5/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	790	803	90,505	2018/12/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	690	701	79,036	2019/ 1/31
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	340	345	38,948	2019/ 2/28
1.50% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	330	335	37,762	2019/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	510	520	58,629	2019/ 3/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	510	520	58,638	2019/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	480	490	55,214	2019/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	660	673	75,885	2019/ 7/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	550	561	63,228	2019/ 8/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	500	509	57,431	2019/12/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	840	855	96,344	2020/ 6/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	890	895	100,927	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	670	673	75,849	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	420	412	46,430	2026/ 2/15
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	480	491	55,328	2018/10/31
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	490	501	56,559	2019/ 9/30
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	470	477	53,782	2022/ 2/28
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	720	730	82,321	2022/ 3/31
1.75% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	150	152	17,144	2022/ 4/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	720	736	82,961	2020/10/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	340	344	38,834	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,130	1,141	128,671	2023/ 5/15
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	700	711	80,157	2017/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	650	661	74,489	2017/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	540	549	61,940	2017/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	260	267	30,136	2020/ 6/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	530	542	61,148	2021/11/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	480	489	55,180	2022/ 8/31
2% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	743	83,740	2021/ 8/31
2.0% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,080	1,109	124,993	2023/ 2/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	630	651	73,362	2020/ 7/31
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	520	537	60,607	2020/ 9/30
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	600	620	69,889	2020/11/30
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	744	83,886	2021/ 2/28
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	670	692	78,055	2021/ 5/31
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	742	83,626	2021/10/31
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	897	101,133	2021/11/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	780	804	90,616	2022/ 2/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,350	1,373	154,756	2025/ 2/15
2.00% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	990	1,004	113,209	2025/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	680	706	79,615	2020/ 8/31

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	
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	570	592	66,811	2021/ 1/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	690	717	80,804	2021/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	1,018	114,748	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	700	726	81,895	2021/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	820	850	95,826	2021/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	642	72,366	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	420	434	49,000	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	520	533	60,159	2025/ 5/15
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	510	533	60,106	2021/ 3/31
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	660	690	77,796	2021/ 4/30
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	730	763	86,067	2021/ 7/31
2.25% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,060	1,100	124,050	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	670	686	77,371	2017/11/30
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	270	279	31,440	2018/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	630	652	73,578	2025/11/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	610	623	70,233	2017/ 7/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	380	392	44,270	2018/ 5/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	570	590	66,485	2018/ 6/30
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	600	630	71,062	2020/12/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,370	1,437	161,969	2024/ 8/15
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	570	582	65,672	2017/ 6/30
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,310	1,387	156,386	2024/ 5/15
2.5% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	570	551	62,175	2045/ 2/15
2.50% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	930	987	111,300	2023/ 8/15
2.50% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	130	125	14,178	2046/ 2/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	220	227	25,618	2018/ 1/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	820	869	97,955	2020/ 8/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,150	1,220	137,569	2020/11/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	530	542	61,134	2017/ 5/31
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	300	310	34,968	2017/12/31
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	300	311	35,076	2018/ 2/28
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,090	1,176	132,512	2024/ 2/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	490	502	56,623	2042/ 8/15
2.75% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	660	675	76,146	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	410	431	48,649	2019/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,210	1,305	147,154	2023/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	390	406	45,771	2018/ 3/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	570	596	67,223	2043/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	810	846	95,349	2045/ 8/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	170	183	20,665	2042/ 5/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	700	750	84,539	2044/11/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	770	824	92,925	2045/ 5/15
3.00% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	540	578	65,230	2045/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	580	595	67,069	2017/ 4/30
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	560	597	67,374	2019/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	930	1,013	114,182	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	298	33,622	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	408	46,069	2042/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	50	55	6,198	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	640	703	79,214	2044/ 8/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	780	844	95,161	2019/11/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	900	1,036	116,758	2044/ 5/15

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	
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	290	304	34,346	2018/ 2/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	840	918	103,502	2020/ 5/15
3.50% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	40	47	5,329	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	580	630	71,032	2019/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,150	1,260	142,064	2020/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,150	1,277	143,906	2021/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	780	941	106,072	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	960	1,156	130,365	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	510	548	61,839	2018/11/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	90	110	12,422	2041/ 8/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	930	1,147	129,312	2043/11/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	440	469	52,875	2018/ 5/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	40	49	5,613	2040/ 8/15
4.00% US TREASURY N/B	国債証券	4.0	300	323	36,421	2018/ 8/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	490	517	58,331	2017/11/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	220	289	32,608	2039/ 5/15
4.25% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	290	381	42,993	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	250	334	37,677	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	680	909	102,488	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	320	429	48,393	2041/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	400	417	46,994	2017/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	40	4,616	2038/ 5/15
4.50% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	470	639	72,078	2039/ 8/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	230	313	35,343	2036/ 2/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	400	553	62,385	2040/ 2/15
4.75% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	490	691	77,962	2041/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	350	369	41,613	2017/ 8/15
5.00% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	130	189	21,300	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	170	231	26,083	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	163	18,472	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	230	328	36,963	2031/ 2/15
5.50% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	166	18,717	2028/ 8/15
6.00% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	140	192	21,727	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	130	186	21,021	2027/11/15
6.25% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	264	29,821	2023/ 8/15
6.25% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	150	227	25,647	2030/ 5/15
6.50% US TREASURY N/B	国債証券	6.5	90	130	14,660	2026/11/15
8.00% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	260	353	39,784	2021/11/15
8.125% US TREASURY N/B	国債証券	8.125	140	173	19,505	2019/ 8/15
8.75% US TREASURY N/B	国債証券	8.75	310	338	38,096	2017/ 5/15
8.75% US TREASURY N/B	国債証券	8.75	210	277	31,247	2020/ 8/15
8.875% US TREASURY N/B	国債証券	8.875	40	49	5,535	2019/ 2/15
小計	—	—	—	—	13,140,722	—
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
0.25% CANADA GOV' T	国債証券	0.25	240	239	20,765	2017/ 5/ 1
0.75% CANADA GOV' T	国債証券	0.75	90	90	7,840	2021/ 3/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	460	464	40,300	2017/ 8/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	180	182	15,826	2018/ 2/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	120	121	10,556	2018/ 3/ 1
1.25% CANADA GOV' T	国債証券	1.25	140	142	12,358	2018/ 9/ 1
1.5 % CANADA GOV' T	国債証券	1.5	370	382	33,224	2020/ 3/ 1
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	280	282	24,516	2017/ 3/ 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	
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	260	263	22,871	2017/ 9/ 1
1.50% CANADA GOV' T	国債証券	1.5	310	320	27,816	2023/ 6/ 1
1.75% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	100	103	9,020	2019/ 9/ 1
1.75% CANADA GOV' T	国債証券	1.75	200	206	17,961	2019/ 3/ 1
2.25% CANADA GOV' T	国債証券	2.25	160	174	15,105	2025/ 6/ 1
2.50% CANADA GOV' T	国債証券	2.5	200	221	19,194	2024/ 6/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	190	211	18,364	2022/ 6/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	60	70	6,092	2048/12/ 1
2.75% CANADA GOV' T	国債証券	2.75	120	147	12,836	2064/12/ 1
3.25% CANADA GOV' T	国債証券	3.25	310	349	30,371	2021/ 6/ 1
3.50% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	220	246	21,358	2020/ 6/ 1
3.50% CANADA GOV' T	国債証券	3.5	200	265	23,077	2045/12/ 1
3.75% CANADA GOV' T	国債証券	3.75	350	384	33,387	2019/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	280	291	25,279	2017/ 6/ 1
4.00% CANADA GOV' T	国債証券	4.0	290	401	34,856	2041/ 6/ 1
4.25% CANADA GOV' T	国債証券	4.25	170	183	15,928	2018/ 6/ 1
5.00% CANADA GOV' T	国債証券	5.0	330	499	43,371	2037/ 6/ 1
5.75% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	270	401	34,831	2029/ 6/ 1
5.75% CANADA GOV' T	国債証券	5.75	270	422	36,711	2033/ 6/ 1
8.00% CANADA GOV' T	国債証券	8.0	100	167	14,542	2027/ 6/ 1
小計	—	—	—	—	628,368	—
(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	3,400	3,414	22,295	2018/ 6/14
5.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.0	3,850	3,888	25,391	2017/ 6/15
5.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.0	800	796	5,197	2019/12/11
6.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	900	938	6,127	2022/ 6/ 9
7.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	3,100	3,416	22,309	2027/ 6/ 3
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	3,690	3,908	25,519	2017/12/14
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,591	16,922	2031/ 5/29
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	900	1,005	6,565	2034/11/23
7.75% MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	4,180	4,671	30,505	2042/11/13
8.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,240	4,678	30,552	2020/ 6/11
8.00% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	3,040	3,455	22,566	2023/12/ 7
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	4,360	4,768	31,138	2018/12/13
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	2,980	3,547	23,164	2029/ 5/31
8.50% MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	4,290	28,016	2038/11/18
小計	—	—	—	—	296,274	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	370	376	48,061	2020/ 4/17
0.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	410	416	53,147	2018/ 4/13
0.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	530	551	70,449	2025/ 2/15
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	380	383	49,016	2017/ 4/ 7
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	160	162	20,740	2017/10/13
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	410	417	53,336	2018/ 2/23
0.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	50	51	6,595	2026/ 2/15
1% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	270	293	37,478	2024/ 8/15
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	330	342	43,746	2018/10/12
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	360	375	47,962	2019/ 2/22
1.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	480	520	66,432	2025/ 8/15
1.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	220	248	31,704	2024/ 5/15
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	440	489	62,565	2022/ 9/ 4
1.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	620	693	88,540	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	470	60,118	2023/ 5/15
1.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	480	541	69,092	2022/ 7/ 4
1.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	420	481	61,502	2024/ 2/15
2.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	360	408	52,104	2022/ 1/ 4
2.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	360	417	53,350	2023/ 8/15
2.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	300	335	42,868	2020/ 9/ 4
2.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	370	422	53,934	2021/ 9/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	390	443	56,685	2021/ 1/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	250	355	45,445	2044/ 7/ 4
2.50% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	200	288	36,798	2046/ 8/15
3.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.0	430	493	62,960	2020/ 7/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	360	410	52,431	2020/ 1/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	380	452	57,770	2021/ 7/ 4
3.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	160	253	32,329	2042/ 7/ 4
3.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.5	370	418	53,405	2019/ 7/ 4
3.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.75	430	480	61,374	2019/ 1/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	440	474	60,654	2018/ 1/ 4
4.00% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	430	704	89,916	2037/ 1/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	400	423	54,139	2017/ 7/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	580	642	82,050	2018/ 7/ 4
4.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	260	454	57,990	2039/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	270	415	53,070	2028/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	220	377	48,220	2034/ 7/ 4
4.75% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	330	621	79,410	2040/ 7/ 4
5.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	260	446	57,031	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	330	536	68,462	2028/ 1/ 4
6.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	250	374	47,807	2024/ 1/ 4
6.25% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	140	250	32,035	2030/ 1/ 4
6.5% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	270	459	58,679	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.25	360	361	46,211	2018/ 5/15
0.70% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.7	100	102	13,029	2020/ 5/ 1
0.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.75	380	385	49,176	2018/ 1/15
1.05% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.05	340	351	44,876	2019/12/ 1
1.35% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	290	303	38,714	2022/ 4/15
1.45% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	50	52	6,699	2022/ 9/15
1.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	370	387	49,422	2019/ 8/ 1
1.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	420	433	55,334	2025/ 6/ 1
1.65% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	365	46,729	2032/ 3/ 1
2.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	80	85	10,941	2025/12/ 1
2.15% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	230	251	32,099	2021/12/15
2.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	220	245	31,352	2024/12/ 1
2.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	450	483	61,717	2019/ 5/ 1
2.70% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	120	128	16,436	2047/ 3/ 1
3.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	180	215	27,530	2046/ 9/ 1
3.5% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	170	209	26,721	2030/ 3/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	200	211	26,954	2017/11/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	330	354	45,322	2018/ 6/ 1
3.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	400	436	55,794	2018/12/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	470	547	69,958	2021/ 3/ 1
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	740	94,586	2021/ 8/ 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	
3.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	370	449	57,445	2024/ 9/ 1
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	470	547	69,940	2020/ 9/ 1
4.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	530	700	89,447	2037/ 2/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	270	302	38,582	2019/ 2/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	480	547	69,926	2019/ 9/ 1
4.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.25	430	498	63,685	2020/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	490	530	67,729	2018/ 2/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	550	607	77,595	2018/ 8/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	520	587	74,990	2019/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	460	536	68,522	2020/ 2/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	290	364	46,546	2023/ 5/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	520	659	84,246	2024/ 3/ 1
4.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	320	417	53,290	2026/ 3/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	360	378	48,348	2017/ 5/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	370	390	49,876	2017/ 6/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	350	430	55,037	2021/ 9/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	480	614	78,501	2023/ 8/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	170	231	29,506	2028/ 9/ 1
4.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	290	436	55,760	2044/ 9/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	460	578	73,932	2022/ 3/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	440	584	74,685	2025/ 3/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	370	544	69,508	2034/ 8/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	350	531	67,882	2039/ 8/ 1
5.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	420	635	81,212	2040/ 9/ 1
5.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	580	620	79,272	2017/ 8/ 1
5.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	570	820	104,830	2029/11/ 1
5.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	410	534	68,268	2022/ 9/ 1
5.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	390	510	65,142	2022/11/ 1
5.75% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	350	547	69,956	2033/ 2/ 1
6.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	570	890	113,667	2031/ 5/ 1
6.50% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	510	781	99,735	2027/11/ 1
7.25% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	220	348	44,540	2026/11/ 1
9.00% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	159	20,340	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	—	500	505	64,494	2020/ 5/25
0.25% FRANCE GOV' T	国債証券	0.25	210	214	27,377	2020/11/25
0.5% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	500	514	65,720	2019/11/25
0.5% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	600	608	77,761	2025/ 5/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	410	417	53,351	2017/ 7/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	530	546	69,724	2018/ 5/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	490	508	64,875	2018/11/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	340	354	45,250	2019/ 5/25
1.00% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	550	580	74,126	2025/11/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	680	762	97,343	2023/ 5/25
1.75% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	650	733	93,629	2024/11/25
2.25% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	500	574	73,325	2022/10/25
2.25% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	610	712	90,952	2024/ 5/25
2.5% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	610	744	95,112	2030/ 5/25
2.50% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	740	832	106,272	2020/10/25
2.75% FRANCE GOV' T	国債証券	2.75	610	754	96,327	2027/10/25
3.00% FRANCE GOV' T	国債証券	3.0	470	557	71,230	2022/ 4/25
3.25% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	610	725	92,596	2021/10/25

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	
3.25% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	150	216	27,667	2045/ 5/25
3.50% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	650	750	95,779	2020/ 4/25
3.50% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	640	832	106,328	2026/ 4/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	700	731	93,394	2017/ 4/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	800	916	117,054	2019/10/25
3.75% FRANCE GOV' T	国債証券	3.75	690	828	105,735	2021/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	610	665	85,016	2018/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	440	679	86,799	2038/10/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	340	587	75,043	2055/ 4/25
4.00% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	290	510	65,189	2060/ 4/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	400	429	54,844	2017/10/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	550	615	78,635	2018/10/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	650	742	94,766	2019/ 4/25
4.25% FRANCE GOV' T	国債証券	4.25	790	1,038	132,661	2023/10/25
4.50% FRANCE GOV' T	国債証券	4.5	370	626	80,016	2041/ 4/25
4.75% FRANCE GOV' T	国債証券	4.75	470	766	97,902	2035/ 4/25
5.50% FRANCE GOV' T	国債証券	5.5	570	909	116,134	2029/ 4/25
5.75% FRANCE GOV' T	国債証券	5.75	480	834	106,581	2032/10/25
6.00% FRANCE GOV' T	国債証券	6.0	220	338	43,172	2025/10/25
8.50% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	80	105	13,453	2019/10/25
8.50% FRANCE GOV' T	国債証券	8.5	170	271	34,727	2023/ 4/25
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	0.25	40	40	5,111	2025/ 7/15
0.25% NETHERLANDS GOV' TT	国債証券	0.25	240	245	31,383	2020/ 1/15
0.50% NETHERLANDS GOV' TT	国債証券	0.5	270	272	34,834	2017/ 4/15
1.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	1.25	240	247	31,601	2018/ 1/15
1.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	1.25	200	209	26,748	2019/ 1/15
1.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	1.75	460	519	66,284	2023/ 7/15
2.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.0	70	80	10,336	2024/ 7/15
2.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.25	310	356	45,552	2022/ 7/15
2.50% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.5	270	346	44,243	2033/ 1/15
2.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	2.75	140	206	26,311	2047/ 1/15
3.25% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.25	280	332	42,406	2021/ 7/15
3.50% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.5	320	373	47,643	2020/ 7/15
3.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	270	340	43,495	2023/ 1/15
3.75% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	3.75	260	432	55,214	2042/ 1/15
4.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	300	330	42,232	2018/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	270	309	39,516	2019/ 7/15
4.00% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.0	310	501	64,024	2037/ 1/15
4.50% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	4.5	310	329	42,140	2017/ 7/15
5.5% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	5.5	250	395	50,524	2028/ 1/15
7.50% NETHERLANDS GOV' T	国債証券	7.5	80	121	15,500	2023/ 1/15
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.25% SPANISH GOV' T	国債証券	0.25	210	210	26,934	2018/ 4/30
0.5% SPANISH GOV' T	国債証券	0.5	390	393	50,201	2017/10/31
1.15% SPANISH GOV' T	国債証券	1.15	110	113	14,538	2020/ 7/30
1.4% SPANISH GOV' T	国債証券	1.4	280	292	37,318	2020/ 1/31
1.6% SPANISH GOV' T	国債証券	1.6	420	431	55,087	2025/ 4/30
1.95% SPANISH GOV' T	国債証券	1.95	250	252	32,209	2030/ 7/30
2.10% SPANISH GOV' T	国債証券	2.1	170	173	22,210	2017/ 4/30
2.15% SPANISH GOV' T	国債証券	2.15	140	149	19,133	2025/10/31
2.75% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	390	421	53,782	2019/ 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	
2.75% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	430	481	61,533	2024/10/31
3.75% SPANISH GOV' T	国債証券	3.75	420	460	58,766	2018/10/31
3.80% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	470	564	72,112	2024/ 4/30
4.00% SPANISH GOV' T	国債証券	4.0	480	552	70,490	2020/ 4/30
4.10% SPANISH GOV' T	国債証券	4.1	480	525	67,094	2018/ 7/30
4.20% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	390	510	65,142	2037/ 1/31
4.30% SPANISH GOV' T	国債証券	4.3	340	389	49,748	2019/10/31
4.40% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	360	448	57,253	2023/10/31
4.50% SPANISH GOV' T	国債証券	4.5	400	432	55,283	2018/ 1/31
4.60% SPANISH GOV' T	国債証券	4.6	470	538	68,823	2019/ 7/30
4.65% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	340	438	56,022	2025/ 7/30
4.70% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	270	381	48,763	2041/ 7/30
4.80% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	340	434	55,544	2024/ 1/31
4.85% SPANISH GOV' T	国債証券	4.85	400	481	61,474	2020/10/31
4.90% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	260	375	48,000	2040/ 7/30
5.15% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	330	455	58,226	2028/10/31
5.15% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	180	274	34,998	2044/10/31
5.40% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	360	468	59,832	2023/ 1/31
5.50% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	450	483	61,694	2017/ 7/30
5.50% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	390	488	62,413	2021/ 4/30
5.75% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	370	563	71,960	2032/ 7/30
5.85% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	410	533	68,095	2022/ 1/31
5.90% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	270	384	49,073	2026/ 7/30
6.00% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	193	24,660	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	310	321	41,039	2025/ 6/22
1.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	90	90	11,541	2031/ 6/22
1.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	260	269	34,460	2018/ 6/22
2.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	290	336	42,936	2023/ 6/22
2.60% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	300	358	45,761	2024/ 6/22
3.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	130	145	18,559	2019/ 9/28
3.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	70	92	11,784	2034/ 6/22
3.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.5	230	241	30,807	2017/ 6/28
3.75% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	300	354	45,286	2020/ 9/28
3.75% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	150	234	29,964	2045/ 6/22
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	130	135	17,333	2017/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	200	217	27,813	2018/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	210	237	30,380	2019/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	310	387	49,424	2022/ 3/28
4.00% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	170	246	31,501	2032/ 3/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	270	336	42,926	2021/ 9/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	260	332	42,511	2022/ 9/28
4.25% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	270	441	56,404	2041/ 3/28
4.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	260	363	46,452	2026/ 3/28
5.0% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	370	619	79,123	2035/ 3/28
5.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	150	163	20,865	2017/ 9/28
5.50% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	340	529	67,649	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	31,873	2018/10/19
1.2% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	70	75	9,642	2025/10/20
1.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	170	190	24,342	2024/10/21
1.75% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	240	270	34,521	2023/10/20

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	
3.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	110	161	20,649	2044/ 6/20
3.40% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	220	270	34,524	2022/11/22
3.50% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	320	384	49,126	2021/ 9/15
3.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	150	184	23,524	2022/ 4/20
3.80% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	92	11,823	2062/ 1/26
3.90% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.9	240	283	36,207	2020/ 7/15
4.15% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	280	443	56,616	2037/ 3/15
4.30% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.3	240	256	32,774	2017/ 9/15
4.35% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.35	290	330	42,236	2019/ 3/15
4.65% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.65	50	54	6,969	2018/ 1/15
4.85% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	258	33,001	2026/ 3/15
6.25% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	190	309	39,548	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	41	5,250	2020/ 9/15
0.75% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	60	59	7,606	2031/ 4/15
0.875%FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	60	62	8,020	2025/ 9/15
1.50% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	110	121	15,468	2023/ 4/15
1.625%FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	100	110	14,150	2022/ 9/15
1.875%FINNISH GOV' T	国債証券	1.875	50	51	6,540	2017/ 4/15
2.00% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	90	103	13,159	2024/ 4/15
2.625%FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	40	54	6,990	2042/ 7/ 4
2.75% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	120	150	19,225	2028/ 7/ 4
3.375%FINNISH GOV' T	国債証券	3.375	110	126	16,141	2020/ 4/15
3.50% FINNISH GOV' T	国債証券	3.5	160	189	24,250	2021/ 4/15
3.875%FINNISH GOV' T	国債証券	3.875	150	159	20,369	2017/ 9/15
4.00% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	100	133	17,093	2025/ 7/ 4
4.375%FINNISH GOV' T	国債証券	4.375	160	184	23,607	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	140	149	19,059	2045/ 2/18
2.40% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	120	139	17,820	2030/ 5/15
3.40% IRISH GOV' T 2024	国債証券	3.4	140	171	21,886	2024/ 3/18
3.90% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	80	99	12,717	2023/ 3/20
4.40% IRISH GOV' T	国債証券	4.4	270	309	39,526	2019/ 6/18
4.50% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	40	44	5,732	2018/10/18
4.50% IRISH GOV' T	国債証券	4.5	50	59	7,561	2020/ 4/18
5.00% IRISH GOV' T	国債証券	5.0	160	196	25,059	2020/10/18
5.40% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	240	338	43,213	2025/ 3/13
5.50% IRISH GOV' T	国債証券	5.5	180	196	25,073	2017/10/18
5.90% IRISH GOV' T	国債証券	5.9	250	303	38,728	2019/10/18
小 計	—	—	—	—	12,683,058	—
(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	510	514	83,256	2017/ 9/ 7
1.25% UK TREASURY	国債証券	1.25	510	519	84,049	2018/ 7/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	500	518	83,874	2019/ 7/22
1.75% UK TREASURY	国債証券	1.75	480	500	81,009	2022/ 9/ 7
2% UK TREASURY	国債証券	2.0	450	473	76,594	2020/ 7/22
2.00% UK TREASURY	国債証券	2.0	300	314	50,936	2025/ 9/ 7
2.25% UK TREASURY	国債証券	2.25	520	558	90,361	2023/ 9/ 7
2.50% UK TREASURY	国債証券	2.5	150	164	26,639	2065/ 7/22
2.75% UK TREASURY	国債証券	2.75	320	355	57,576	2024/ 9/ 7
3.25% UK TREASURY	国債証券	3.25	250	296	48,065	2044/ 1/22
3.5% UK TREASURY	国債証券	3.5	50	62	10,067	2045/ 1/22

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	
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
3.50% UK TREASURY	国債証券	3.5	420	592	95,861	2068/ 7/22
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	380	421	68,205	2019/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	460	520	84,344	2020/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	440	506	82,017	2021/ 9/ 7
3.75% UK TREASURY	国債証券	3.75	320	440	71,270	2052/ 7/22
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	280	329	53,357	2022/ 3/ 7
4.00% UK TREASURY	国債証券	4.0	220	333	53,985	2060/ 1/22
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	250	319	51,725	2027/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	458	74,262	2032/ 6/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	386	62,626	2036/ 3/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	240	325	52,714	2039/ 9/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	340	465	75,427	2040/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	360	514	83,280	2046/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	260	381	61,810	2049/12/ 7
4.25% UK TREASURY	国債証券	4.25	330	511	82,859	2055/12/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	391	63,359	2019/ 3/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	476	77,192	2034/ 9/ 7
4.50% UK TREASURY	国債証券	4.5	390	560	90,807	2042/12/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	380	440	71,343	2020/ 3/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	380	519	84,055	2030/12/ 7
4.75% UK TREASURY	国債証券	4.75	320	462	74,840	2038/12/ 7
5.00% UK TREASURY	国債証券	5.0	360	392	63,554	2018/ 3/ 7
5.00% UK TREASURY	国債証券	5.0	330	431	69,928	2025/ 3/ 7
6.00% UK TREASURY	国債証券	6.0	190	284	46,113	2028/12/ 7
8.00% UK TREASURY	国債証券	8.0	30	40	6,619	2021/ 6/ 7
小計	—	—	—	—	2,393,998	—
(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	8,016	2021/ 4/28
3.00% SWITZERLAND	国債証券	3.0	150	160	18,726	2018/ 1/ 8
3.00% SWITZERLAND	国債証券	3.0	170	191	22,306	2019/ 5/12
4.00% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	132	15,445	2023/ 2/11
4.00% SWITZERLAND	国債証券	4.0	100	151	17,718	2028/ 4/ 8
4.25% SWITZERLAND	国債証券	4.25	50	53	6,189	2017/ 6/ 5
小計	—	—	—	—	88,403	—
(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	700	760	10,533	2023/11/13
2.50% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	300	352	4,882	2025/ 5/12
3.5% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,520	1,831	25,365	2022/ 6/ 1
3.5% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	1,880	26,039	2039/ 3/30
3.75% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.75	1,120	1,187	16,447	2017/ 8/12
4.25% SWEDEN GOV' T	国債証券	4.25	1,960	2,234	30,951	2019/ 3/12
5.00% SWEDEN GOV' T	国債証券	5.0	2,000	2,480	34,348	2020/12/ 1
小計	—	—	—	—	148,568	—
(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	886	12,021	2025/ 3/13
2.00% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,360	1,463	19,848	2023/ 5/24
3.00% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	210	241	3,280	2024/ 3/14
3.75% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,400	1,615	21,907	2021/ 5/25
4.25% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.25	1,030	1,074	14,567	2017/ 5/19
4.50% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	4.5	830	934	12,675	2019/ 5/22
小計	—	—	—	—	84,300	—

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	1,200	1,322	22,672	2023/11/15
1.75% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	300	337	5,786	2025/11/15
3.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	2,060	2,418	41,459	2021/11/15
4.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,060	1,136	19,481	2017/11/15
4.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.0	1,520	1,757	30,130	2019/11/15
4.50% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,450	4,280	73,365	2039/11/15
7.00% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	7.0	560	886	15,196	2024/11/10
小計	—	—	—	—	208,092	—
(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	—	620	609	18,182	2017/ 7/25
2.50% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	890	910	27,163	2018/ 7/25
2.50% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	180	174	5,204	2026/ 7/25
3.25% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	170	178	5,336	2019/ 7/25
3.25% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	430	448	13,370	2025/ 7/25
4.00% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	780	857	25,577	2023/10/25
4.75% POLAND GOV' T	国債証券	4.75	270	279	8,346	2017/ 4/25
5.25% POLAND GOV' T	国債証券	5.25	460	487	14,547	2017/10/25
5.25% POLAND GOV' T	国債証券	5.25	330	377	11,251	2020/10/25
5.5% POLAND GOV' T	国債証券	5.5	310	350	10,462	2019/10/25
5.75% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	510	603	18,021	2021/10/25
5.75% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	793	23,676	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	181,139	—
(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	
1.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	1.75	110	108	9,350	2020/11/21
2.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	250	256	22,129	2019/10/21
2.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	390	399	34,488	2024/ 4/21
2.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	100	95	8,207	2035/ 6/21
3.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	380	403	34,793	2025/ 4/21
3.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	320	337	29,112	2029/ 4/21
3.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	260	284	24,566	2037/ 4/21
4.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	240	247	21,310	2017/ 7/21
4.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	220	253	21,880	2026/ 4/21
4.50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	540	592	51,083	2020/ 4/15
4.520% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	140	169	14,607	2033/ 4/21
4.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	470	568	49,046	2027/ 4/21
5.25% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.25	490	536	46,268	2019/ 3/15
5.50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	510	542	46,767	2018/ 1/21
5.50% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	310	374	32,264	2023/ 4/21
5.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	320	375	32,424	2021/ 5/15
5.75% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	730	879	75,876	2022/ 7/15
小計	—	—	—	—	554,178	—
(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	188	15,688	2018/ 4/ 1
2.00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.0	70	72	6,005	2020/ 7/ 1
2.25% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.25	50	51	4,312	2021/ 6/ 1
2.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.375	90	91	7,614	2017/ 4/ 1
2.50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.5	60	62	5,224	2019/ 6/ 1
2.75% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	110	116	9,678	2042/ 4/ 1
3.00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	220	238	19,900	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	60	65	5,431	2022/ 9/ 1
3.25% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.25	100	108	9,023	2020/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	60	68	5,668	2033/ 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)		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
3.50% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	140	160	13,375	2027/ 3/ 1
4.00% SINGAPORE GOV' T	国債証券	4.0	130	139	11,626	2018/ 9/ 1
小計	—	—	—	—	113,550	—
(マレーシア)		%	千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット	千円	
3.314%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.314	250	251	7,221	2017/10/31
3.394%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.394	450	453	12,997	2017/ 3/15
3.48% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.48	300	294	8,437	2023/ 3/15
3.492%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.492	410	410	11,765	2020/ 3/31
3.502%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	404	11,606	2027/ 5/31
3.58% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.58	550	554	15,900	2018/ 9/28
3.795%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.795	30	30	864	2022/ 9/30
3.889%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.889	300	304	8,730	2020/ 7/31
3.955%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	540	545	15,628	2025/ 9/15
4.012%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.012	70	71	2,042	2017/ 9/15
4.048%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	250	255	7,317	2021/ 9/30
4.16% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	330	339	9,717	2021/ 7/15
4.181%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	310	316	9,070	2024/ 7/15
4.24% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.24	440	448	12,867	2018/ 2/ 7
4.378%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.378	210	216	6,218	2019/11/29
4.498%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	130	133	3,829	2030/ 4/15
4.935%MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	186	5,345	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	149,562	—
(南アフリカ)		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
10.5% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	10.5	2,670	2,907	21,925	2026/12/21
6.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.25	1,510	1,048	7,907	2036/ 3/31
6.50% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.5	3,120	2,140	16,138	2041/ 2/28
6.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.75	3,580	3,293	24,833	2021/ 3/31
7.00% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.0	3,270	2,599	19,603	2031/ 2/28
7.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.25	30	28	216	2020/ 1/15
7.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.75	360	336	2,538	2023/ 2/28
8.00% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.0	2,420	2,393	18,044	2018/12/21
8.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.25	100	100	755	2017/ 9/15
8.25% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.25	920	811	6,118	2032/ 3/31
8.75% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	1,890	1,674	12,627	2048/ 2/28
小計	—	—	—	—	130,709	—
合計	—	—	—	—	30,800,926	—

(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(2016年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 30,800,927	% 98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	410,226	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	31,211,153	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純資産(31,202,597千円)の投資信託財産総額(31,211,153千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2016年3月31日における邦貨換算レートは1米ドル=112.68円、1カナダドル=86.79円、1メキシコペソ=6.53円、1ユーロ=127.70円、1英ポンド=161.92円、1スイスフラン=116.74円、1スウェーデンクローナ=13.85円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=17.14円、1ポーランドズロチ=29.84円、1オーストラリアドル=86.25円、1シンガポールドル=83.31円、1マレーシアリンギット=28.66円、1南アフリカランド=7.54円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2016年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	31,240,975,638 円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	106,039,536
公 社 債(評価額)	30,800,927,194
未 収 入 金	59,610,735
未 収 利 息	265,625,560
前 払 費 用	8,772,613
(B) 負 債	43,979,884
未 払 金	29,879,884
未 払 解 約 金	14,100,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	31,196,995,754
元 本	14,323,589,099
次 期 繰 越 損 益 金	16,873,406,655
(D) 受 益 権 総 口 数	14,323,589,099 口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	21,780 円

(注1) 当ファンドの期首元本額は14,178,396,947円、期中追加設定元本額は883,455,371円、期中一部解約元本額は738,263,219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	6,832,563,516円
日立外国債券特化型ファンドI(為替ヘッジなし)(非課税適格機関投資家専用)	5,445,247,851円
日立バランスファンド(株式50)	910,410,130円
日立バランスファンド(株式70)	802,786,895円
日立バランスファンド(株式30)	332,580,707円

(注3) 1口当たり純資産額は2,1780円です。

■損益の状況

当期(自2015年4月1日 至2016年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	801,759,470 円
受 取 利 息	801,759,470
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,892,952,254
売 買 益	208,631,668
売 買 損	△2,101,583,922
(C) 信 託 報 酬 等	△8,691,589
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,099,884,373
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	17,780,113,580
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,109,810,800
(G) 解 約 差 損 益 金	△916,633,352
(H) 計 (D+E+F+G)	16,873,406,655
次 期 繰 越 損 益 金(H)	16,873,406,655

(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。