

Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版）

第3期（決算日 2020年5月25日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）」は、2020年5月25日に第3期の決算を行いましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
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。

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	2017年8月29日から無期限です。
運用方針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	RAM先進国債券マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	①株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

<照会先>

電話番号：0120-223351

（委託会社の営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ： <https://www.resona-am.co.jp/>

りそなアセットマネジメント 株式会社

東京都江東区木場1丁目5番65号

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込 分配 金	期 騰 落 率	(ベンチマーク) 期 騰 落 率	中 率		
(設定日)	円	円	%		%	%	百万円
2017年8月29日	10,000	—	—	112,682.49	—	—	0.1
1期(2018年5月25日)	9,852	0	△1.5	111,558.93	△1.0	98.8	0.347664
2期(2019年5月27日)	10,065	0	2.2	114,246.86	2.4	99.0	49
3期(2020年5月25日)	10,573	0	5.0	120,321.83	5.3	98.6	280

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額(元本=10,000円)です。

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

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債組入比率
	騰落率	騰落率	(ベンチマーク) 騰落率	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2019年5月27日	10,065	—	114,246.86	—	99.0
5月末	10,055	△0.1	114,188.44	△0.1	99.0
6月末	10,185	1.2	115,685.41	1.3	99.1
7月末	10,213	1.5	115,950.32	1.5	98.8
8月末	10,278	2.1	116,876.64	2.3	99.1
9月末	10,325	2.6	117,408.61	2.8	98.7
10月末	10,425	3.6	118,313.83	3.6	99.0
11月末	10,429	3.6	118,546.99	3.8	98.9
12月末	10,474	4.1	118,980.17	4.1	99.0
2020年1月末	10,557	4.9	120,069.31	5.1	99.0
2月末	10,680	6.1	121,401.29	6.3	98.9
3月末	10,694	6.2	121,796.59	6.6	99.0
4月末	10,486	4.2	119,329.72	4.4	98.6
(期末)					
2020年5月25日	10,573	5.0	120,321.83	5.3	98.6

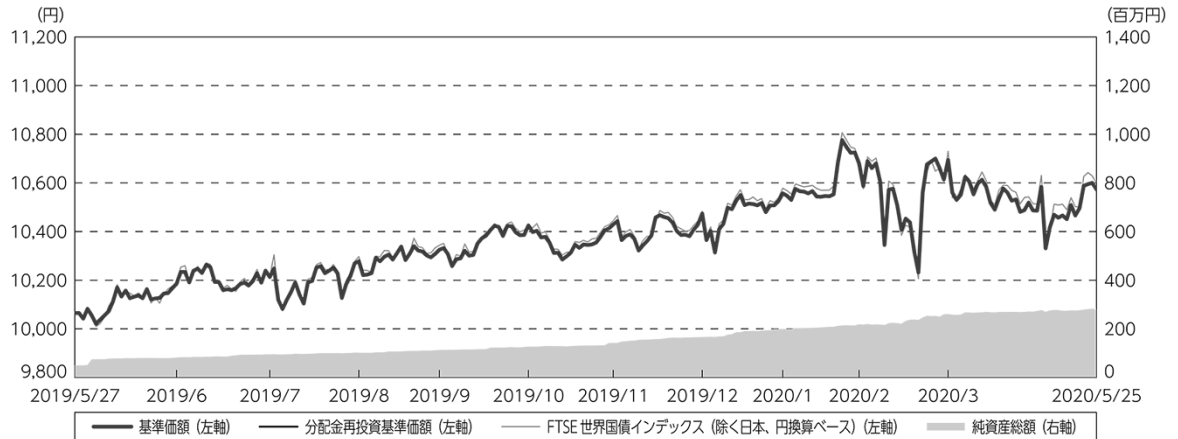
(注) 騰落率は期首比です。

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

○運用経過

(2019年5月28日～2020年5月25日)

期中の基準価額等の推移



期首：10,065円

期末：10,573円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率： 5.0% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、期首(2019年5月27日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は当ファンドのベンチマークです。
- (注) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の変動要因

マザーファンドを通じて投資を行った結果、当ファンドの基準価額は前期末10,065円から当期末10,573円となり、508円の値上がりとなりました。

先進国債券の市況 (FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)) の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも先進国債券の価格が上昇したことが寄与しました。

投資環境

先進国債券市況

先進国金利は、前期末と比較して米欧ともに長期金利は低下（債券価格は上昇）しました。米長期金利は、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界景気の減速懸念から低下基調となり、その後FRB（米連邦準備制度理事会）が約10年半ぶりに利下げを行ったことや、新型肺炎問題への対応として各国中央銀行が緊急利下げを決定したことなどから、先進国金利の水準は大きく低下しました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドル・ユーロなど主要通貨に対して上昇しました。

米ドルに対しては、FRBの金融緩和スタンスを巡り一進一退の動きでしたが、新型肺炎問題を受けて、FRBによる緊急利下げや投資家のリスク回避の動きが円高圧力となる一方、企業や金融機関が米ドルを確保する動きが円安圧力となり、円は対米ドルで一時乱高下しました。その後、金融市場が徐々に落ち着きを取り戻すなか、FRBによるさらなる金融緩和政策への期待から、円高基調で推移しました。

ユーロに対しては、欧州の低調な経済指標、イギリスのEU（欧州連合）離脱問題、および新型肺炎問題等を背景に、運用期間中を通じて円高基調で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RAM先進国債券マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行いました。

RAM先進国債券マザーファンド

日本を除く先進国の債券を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+5.0%となり、ベンチマークの+5.3%を0.3%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

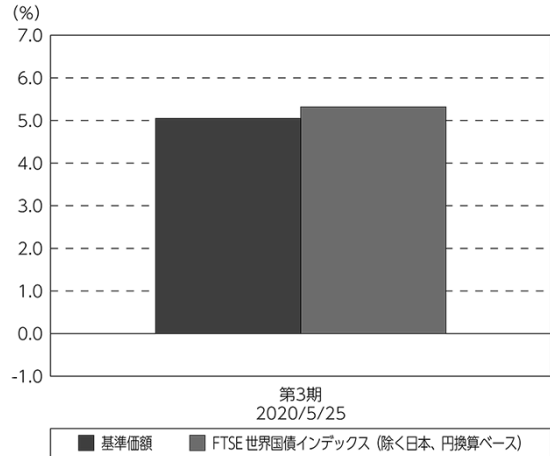
（マイナス要因）

- ・ 信託報酬などの諸費用が生じたこと
- ・ コスト負担（債券等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと

（その他の要因）

- ・ ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、分配を見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第3期
	2019年5月28日～ 2020年5月25日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	573

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

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

当ファンド

引き続き、RAM先進国債券マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行う方針です。

RAM先進国債券マザーファンド

引き続き、主としてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2019年5月28日～2020年5月25日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	19	0.186	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(9)	(0.082)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(9)	(0.082)	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 ）	(2)	(0.022)	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	4	0.034	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(3)	(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
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.009)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	23	0.220	
期中の平均基準価額は、10,400円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

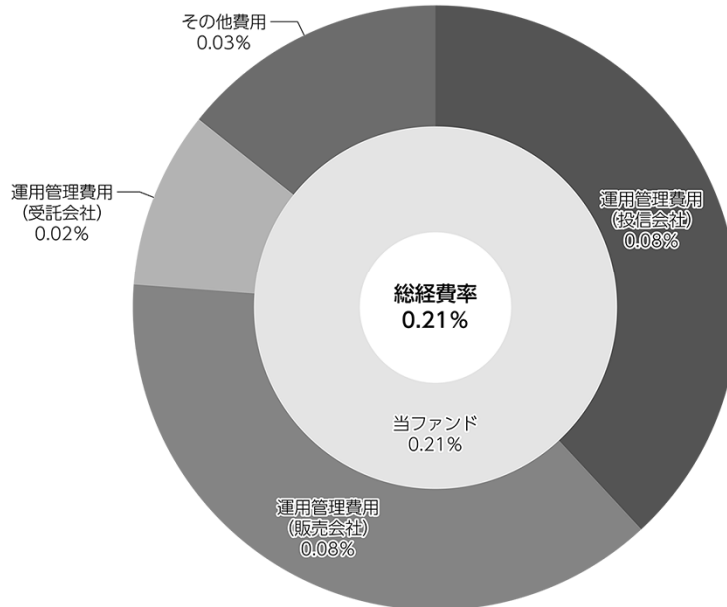
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.21%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2019年5月28日～2020年5月25日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
RAM先進国債券マザーファンド	240,219	242,445	18,720	19,120

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月28日～2020年5月25日)

該当事項はございません。

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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年5月28日～2020年5月25日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2019年5月28日～2020年5月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020年5月25日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
RAM先進国債券マザーファンド	51,142	272,642	280,113

○投資信託財産の構成

(2020年5月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
RAM先進国債券マザーファンド	280,113	98.9
コール・ローン等、その他	3,169	1.1
投資信託財産総額	283,282	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) RAM先進国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（28,699,066千円）の投資信託財産総額（28,851,358千円）に対する比率は99.5%です。

(注) 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。1米ドル=107.65円、1カナダドル=76.95円、1メキシコペソ=4.76円、1ユーロ=117.36円、1英ポンド=131.20円、1スウェーデンクローナ=11.13円、1ノルウェークローネ=10.77円、1デンマーククローネ=15.75円、1ポーランドズロチ=26.00円、1オーストラリアドル=70.44円、1シンガポールドル=75.53円、1マレーシアリングギット=24.69円、1イスラエルシェケル=30.49円。

○特定資産の価格等の調査

(2019年5月28日～2020年5月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月25日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	283,282,250
コール・ローン等	1,038,959
RAM先進国債券マザーファンド(評価額)	280,113,291
未収入金	2,130,000
(B) 負債	2,978,456
未払解約金	2,769,436
未払信託報酬	199,153
未払利息	2
その他未払費用	9,865
(C) 純資産総額(A-B)	280,303,794
元本	265,111,997
次期繰越損益金	15,191,797
(D) 受益権総口数	265,111,997口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,573円

(注) 当ファンドの期首元本額は49,625,697円、期中追加設定元本額は268,028,176円、期中一部解約元本額は52,541,876円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0573円です。

○損益の状況（2019年5月28日～2020年5月25日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 164
支払利息	△ 164
(B) 有価証券売買損益	5,745,881
売買益	6,960,856
売買損	△ 1,214,975
(C) 信託報酬等	△ 308,330
(D) 当期損益金(A+B+C)	5,437,387
(E) 前期繰越損益金	97,734
(F) 追加信託差損益金	9,656,676
(配当等相当額)	(4,648,533)
(売買損益相当額)	(5,008,143)
(G) 計(D+E+F)	15,191,797
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	15,191,797
追加信託差損益金	9,656,676
(配当等相当額)	(5,007,463)
(売買損益相当額)	(4,649,213)
分配準備積立金	5,535,121

(注) 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) 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) 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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,391,668円)、費用控除後の有価証券等損益額(1,852,130円)、信託約款に規定する収益調整金(9,656,676円)および分配準備積立金(291,323円)より分配対象収益は15,191,797円(1万口当たり573円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

○お知らせ

該当事項はございません。

RAM先進国債券マザーファンド

運用報告書

第4期（決算日 2020年1月27日）
（2019年1月26日～2020年1月27日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	<p>①主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>②債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p>
主要投資対象	・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none">・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）の行使等により取得したものに限り。・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

りそなアセットマネジメント 株式会社

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債組入比率	純資産額
	期騰	期中率	(ベンチマーク) 期騰	期中率		
(設定日) 2015年12月11日	円 10,000	% —		% —	% —	百万円 110
1期(2017年1月25日)	9,351	△6.5	109,545.70	△6.9	99.0	7,074
2期(2018年1月25日)	9,857	5.4	115,301.15	5.3	98.9	18,044
3期(2019年1月25日)	9,584	△2.8	112,357.92	△2.6	99.0	31,184
4期(2020年1月27日)	10,177	6.2	119,138.98	6.0	99.1	30,086

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額(元本=10,000円)です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債組入比率
	騰落	騰落率	(ベンチマーク) 騰落	騰落率	
(期首) 2019年1月25日	円 9,584	% —		% —	% 99.0
1月末	9,594	0.1	111,997.50	△0.3	98.9
2月末	9,729	1.5	113,937.65	1.4	99.0
3月末	9,859	2.9	115,474.58	2.8	99.0
4月末	9,831	2.6	115,213.50	2.5	99.0
5月末	9,752	1.8	114,188.44	1.6	99.0
6月末	9,879	3.1	115,685.41	3.0	99.2
7月末	9,908	3.4	115,950.32	3.2	98.9
8月末	9,973	4.1	116,876.64	4.0	99.1
9月末	10,020	4.5	117,408.61	4.5	98.8
10月末	10,119	5.6	118,313.83	5.3	99.1
11月末	10,124	5.6	118,546.99	5.5	99.0
12月末	10,170	6.1	118,980.17	5.9	99.1
(期末) 2020年1月27日	10,177	6.2	119,138.98	6.0	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2019年1月26日～2020年1月27日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の変動要因

基準価額は前期末9,584円から当期末10,177円となり、593円の値上がりとなりました。

先進国債券の市況（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース））の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも先進国の債券価格が上昇したことが作用しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

先進国債券市況

先進国金利は、前期末と比較して、米欧ともに長期金利は低下（債券価格は上昇）しました。米長期金利は、期の前半は米中貿易摩擦問題への警戒感や世界景気の減速懸念からリスク回避の姿勢が強まり、低下基調となりました。その後FRB（米連邦準備制度理事会）の利下げ観測が高まり、期の後半に約10年半ぶりの利下げが決定すると、米長期金利は約3年ぶりの水準まで低下しました。欧州各国の長期金利は、欧州景気の先行き懸念からECB（欧州中央銀行）の緩和観測が高まり、ドイツ長期金利がマイナス圏に転じるなど、期を通じて大幅に低下しました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して横ばいで推移し、ユーロなど主要通貨に対して上昇しました。

米ドルに対しては、期の前半は世界景気の減速懸念や米中対立に対する過度な警戒感が緩和され円安基調となりましたが、FRBの金融緩和観測が広がるにつれ米ドルは売られ円高が進行しました。期の後半は、米国の緩和的な金融政策が当面据え置かれるとの見方を背景に過度な円高圧力は緩和され、期末にかけては緩やかに円安が進行しました。

ユーロに対しては、欧州の低調な経済指標やイギリスのEU（欧州連合）離脱問題等を背景に、期を通じて円高傾向で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

日本を除く先進国の債券を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+6.2%となり、ベンチマークの+6.0%を0.2%上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

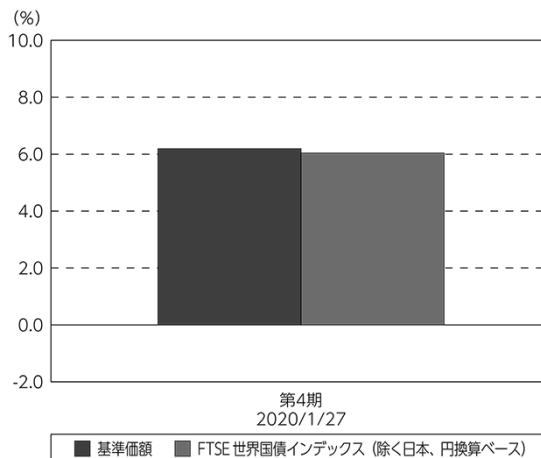
（マイナス要因）

- ・コスト負担（債券等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと

（その他の要因）

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年 1 月26日～2020年 1 月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.024	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(2)	(0.024)	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 ）	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	2	0.024	
期中の平均基準価額は、9,913円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2019年1月26日～2020年1月27日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千米ドル 81,421	千米ドル 88,566
	カナダ	千カナダドル 4,454	千カナダドル 5,274
	メキシコ	千メキシコペソ 20,892	千メキシコペソ 20,374
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 8,079	10,283
	イタリア	国債証券 10,120	12,697
	フランス	国債証券 12,163	14,304
	オランダ	国債証券 1,936	2,682
	スペイン	国債証券 6,959	8,520
	ベルギー	国債証券 2,344	3,060
	オーストリア	国債証券 1,456	1,788
	フィンランド	国債証券 492	794
	アイルランド	国債証券 745	1,026
	イギリス	国債証券 千英ポンド 5,867	千英ポンド 8,106
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローナ 2,916	千スウェーデンクローナ 5,322
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 2,079	千ノルウェークローネ 1,835
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 3,876	千デンマーククローネ 5,678
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 3,131	千ポーランドズロチ 3,887
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 3,849	千オーストラリアドル 4,798
	シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 900	千シンガポールドル 957
	マレーシア	国債証券 千マレーシアリングット 2,088	千マレーシアリングット 2,531
	南アフリカ	国債証券 千南アフリカランド 9,165	千南アフリカランド 10,175

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2019年1月26日～2020年1月27日)

該当事項はございません。

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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年1月26日～2020年1月27日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020年1月27日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	125,260	132,122	14,409,225	47.9	—	20.7	17.6	9.6
カナダ	千カナダドル 6,350	千カナダドル 6,960	577,315	1.9	—	0.9	0.6	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 43,780	千メキシコペソ 46,545	269,501	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	12,850	15,389	1,851,324	6.2	—	3.6	1.7	0.9
イタリア	18,740	21,769	2,618,843	8.7	—	5.2	2.5	1.0
フランス	19,790	24,125	2,902,315	9.6	—	6.5	2.4	0.8
オランダ	3,730	4,563	548,986	1.8	—	1.2	0.5	0.2
スペイン	11,140	13,694	1,647,432	5.5	—	3.7	1.3	0.5
ベルギー	4,550	5,750	691,772	2.3	—	1.7	0.5	0.1
オーストリア	2,834	3,487	419,543	1.4	—	0.9	0.4	0.1
フィンランド	1,240	1,385	166,731	0.6	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	1,530	1,784	214,669	0.7	—	0.5	0.2	—
イギリス	千英ポンド 10,430	千英ポンド 13,940	1,986,701	6.6	—	5.2	1.0	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 6,920	千スウェーデンクローナ 7,858	89,582	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 5,850	千ノルウェークローネ 6,056	72,985	0.2	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 6,650	千デンマーククローネ 8,711	140,248	0.5	—	0.4	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 6,110	172,744	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 6,810	千オーストラリアドル 7,874	585,085	1.9	—	1.4	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 1,450	千シンガポールドル 1,554	125,301	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 5,050	千マレーシアリンギット 5,383	144,647	0.5	—	0.3	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 24,740	千南アフリカランド 22,858	172,812	0.6	0.6	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	29,807,773	99.1	0.6	54.3	30.2	14.6

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 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。

(注) 格付のない債券については、BB格以下組入比率に含まれておりません。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末					
		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		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券						
	US TREASURY N/B	1.75	800	801	87,391	2020/12/31	
	US TREASURY N/B	2.5	260	262	28,596	2020/12/31	
	US TREASURY N/B	2.0	440	441	48,187	2021/1/15	
	US TREASURY N/B	1.375	400	399	43,541	2021/1/31	
	US TREASURY N/B	3.625	630	643	70,170	2021/2/15	
	US TREASURY N/B	2.25	460	463	50,522	2021/2/15	
	US TREASURY N/B	1.125	650	646	70,553	2021/2/28	
	US TREASURY N/B	2.5	850	858	93,637	2021/2/28	
	US TREASURY N/B	2.375	480	484	52,824	2021/3/15	
	US TREASURY N/B	1.25	480	478	52,160	2021/3/31	
	US TREASURY N/B	2.25	600	604	65,966	2021/3/31	
	US TREASURY N/B	2.375	800	807	88,111	2021/4/15	
	US TREASURY N/B	1.375	600	598	65,301	2021/4/30	
	US TREASURY N/B	2.25	800	807	88,013	2021/4/30	
	US TREASURY N/B	3.125	580	591	64,535	2021/5/15	
	US TREASURY N/B	2.625	620	628	68,560	2021/5/15	
	US TREASURY N/B	2.0	480	482	52,674	2021/5/31	
	US TREASURY N/B	1.375	550	548	59,851	2021/5/31	
	US TREASURY N/B	2.625	590	598	65,299	2021/6/15	
	US TREASURY N/B	1.125	820	815	88,917	2021/6/30	
	US TREASURY N/B	1.625	700	700	76,440	2021/6/30	
	US TREASURY N/B	2.625	540	548	59,826	2021/7/15	
	US TREASURY N/B	1.125	970	964	105,162	2021/7/31	
	US TREASURY N/B	1.75	950	953	103,955	2021/7/31	
	US TREASURY N/B	2.125	550	555	60,530	2021/8/15	
	US TREASURY N/B	2.75	890	906	98,883	2021/8/15	
	US TREASURY N/B	1.125	520	516	56,357	2021/8/31	
	US TREASURY N/B	1.5	620	619	67,596	2021/8/31	
	US TREASURY N/B	2.75	710	724	78,969	2021/9/15	
	US TREASURY N/B	1.125	500	496	54,174	2021/9/30	
	US TREASURY N/B	2.125	600	606	66,098	2021/9/30	
	US TREASURY N/B	2.875	750	767	83,676	2021/10/15	
	US TREASURY N/B	1.25	410	408	44,516	2021/10/31	
	US TREASURY N/B	1.5	740	739	80,701	2021/10/31	
	US TREASURY N/B	2.0	810	817	89,139	2021/11/15	
	US TREASURY N/B	2.875	570	583	63,669	2021/11/15	
	US TREASURY N/B	1.75	590	592	64,638	2021/11/30	
	US TREASURY N/B	1.875	600	604	65,892	2021/11/30	
	US TREASURY N/B	1.5	700	700	76,349	2021/11/30	
	US TREASURY N/B	2.625	500	510	55,669	2021/12/15	
	US TREASURY N/B	2.0	560	565	61,655	2021/12/31	
	US TREASURY N/B	2.5	600	611	66,708	2022/1/15	
	US TREASURY N/B	1.5	380	380	41,452	2022/1/31	

銘	柄	当 期 末				
		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	
	国債証券	US TREASURY N/B	490	493	53,843	2022/1/31
		US TREASURY N/B	970	980	106,903	2022/2/15
		US TREASURY N/B	470	472	51,545	2022/2/28
		US TREASURY N/B	650	655	71,455	2022/2/28
		US TREASURY N/B	700	713	77,782	2022/3/15
		US TREASURY N/B	290	291	31,817	2022/3/31
		US TREASURY N/B	460	463	50,587	2022/3/31
		US TREASURY N/B	500	508	55,443	2022/4/15
		US TREASURY N/B	470	472	51,578	2022/4/30
		US TREASURY N/B	700	706	77,014	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1,480	1,489	162,427	2022/5/15
		US TREASURY N/B	510	514	56,146	2022/5/31
		US TREASURY N/B	850	855	93,296	2022/5/31
		US TREASURY N/B	320	322	35,129	2022/6/15
		US TREASURY N/B	390	396	43,207	2022/6/30
		US TREASURY N/B	410	412	45,011	2022/6/30
		US TREASURY N/B	450	453	49,409	2022/7/15
		US TREASURY N/B	360	364	39,776	2022/7/31
		US TREASURY N/B	400	403	44,058	2022/7/31
		US TREASURY N/B	1,050	1,054	115,005	2022/8/15
		US TREASURY N/B	390	394	42,975	2022/8/31
		US TREASURY N/B	480	481	52,563	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1,000	1,000	109,157	2022/9/15
		US TREASURY N/B	520	523	57,139	2022/9/30
		US TREASURY N/B	350	353	38,585	2022/9/30
		US TREASURY N/B	300	299	32,636	2022/10/15
		US TREASURY N/B	330	333	36,386	2022/10/31
		US TREASURY N/B	410	415	45,355	2022/10/31
		US TREASURY N/B	290	291	31,763	2022/11/15
		US TREASURY N/B	670	679	74,160	2022/11/30
		US TREASURY N/B	700	703	76,692	2022/12/15
		US TREASURY N/B	720	733	80,001	2022/12/31
		US TREASURY N/B	400	403	43,989	2023/1/31
		US TREASURY N/B	560	574	62,703	2023/1/31
		US TREASURY N/B	650	660	72,036	2023/2/15
		US TREASURY N/B	610	610	66,599	2023/2/28
		US TREASURY N/B	590	610	66,591	2023/2/28
		US TREASURY N/B	170	170	18,561	2023/3/31
		US TREASURY N/B	90	92	10,129	2023/3/31
		US TREASURY N/B	150	150	16,439	2023/4/30
		US TREASURY N/B	450	468	51,066	2023/4/30
		US TREASURY N/B	640	645	70,426	2023/5/15
		US TREASURY N/B	770	774	84,412	2023/5/31
		US TREASURY N/B	400	416	45,435	2023/5/31
		US TREASURY N/B	470	468	51,102	2023/6/30

銘柄		当期末					
		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		
	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	550	571	62,288	2023/6/30
		US TREASURY N/B	1.25	490	486	53,042	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.75	620	646	70,554	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.5	160	165	18,072	2023/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	600	597	65,211	2023/8/31
		US TREASURY N/B	2.75	730	762	83,141	2023/8/31
		US TREASURY N/B	1.375	540	538	58,680	2023/9/30
		US TREASURY N/B	2.875	480	503	54,956	2023/9/30
		US TREASURY N/B	1.625	540	542	59,212	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.875	650	682	74,484	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.75	710	743	81,054	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	440	450	49,143	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.875	600	631	68,820	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	490	504	55,006	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.625	650	678	73,962	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.25	420	432	47,171	2024/1/31
		US TREASURY N/B	2.75	690	724	78,991	2024/2/15
		US TREASURY N/B	2.125	490	502	54,778	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.375	800	828	90,305	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.125	890	912	99,552	2024/3/31
		US TREASURY N/B	2.0	670	683	74,584	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.5	1,030	1,073	117,033	2024/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,020	1,041	113,613	2024/5/31
		US TREASURY N/B	2.0	390	398	43,443	2024/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	620	626	68,355	2024/6/30
		US TREASURY N/B	2.125	500	513	56,016	2024/7/31
		US TREASURY N/B	1.75	620	626	68,363	2024/7/31
		US TREASURY N/B	2.375	1,190	1,235	134,787	2024/8/15
		US TREASURY N/B	1.875	400	406	44,351	2024/8/31
		US TREASURY N/B	1.25	600	593	64,730	2024/8/31
		US TREASURY N/B	2.125	420	431	47,090	2024/9/30
		US TREASURY N/B	1.5	560	559	61,071	2024/9/30
		US TREASURY N/B	2.25	520	537	58,654	2024/10/31
		US TREASURY N/B	1.5	530	529	57,799	2024/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	970	1,003	109,418	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	400	411	44,881	2024/11/30
		US TREASURY N/B	1.5	800	800	87,270	2024/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	400	414	45,158	2024/12/31
		US TREASURY N/B	2.5	430	450	49,137	2025/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	620	634	69,213	2025/2/15
		US TREASURY N/B	2.75	550	583	63,612	2025/2/28
		US TREASURY N/B	2.625	830	875	95,493	2025/3/31
		US TREASURY N/B	2.875	450	480	52,425	2025/4/30
		US TREASURY N/B	2.125	710	731	79,784	2025/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	440	470	51,298	2025/5/31

銘柄	当 期 末					
	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		
国債証券	US TREASURY N/B	2.75	890	946	103,198	2025/6/30
	US TREASURY N/B	2.875	470	503	54,876	2025/7/31
	US TREASURY N/B	2.0	390	399	43,567	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	570	606	66,183	2025/8/31
	US TREASURY N/B	3.0	530	571	62,360	2025/9/30
	US TREASURY N/B	3.0	570	615	67,125	2025/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	450	467	50,973	2025/11/15
	US TREASURY N/B	2.875	480	515	56,212	2025/11/30
	US TREASURY N/B	2.625	500	530	57,825	2025/12/31
	US TREASURY N/B	2.625	600	636	69,427	2026/1/31
	US TREASURY N/B	1.625	460	461	50,341	2026/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	330	347	37,946	2026/2/28
	US TREASURY N/B	2.25	850	884	96,436	2026/3/31
	US TREASURY N/B	2.375	450	471	51,428	2026/4/30
	US TREASURY N/B	1.625	1,000	1,003	109,402	2026/5/15
	US TREASURY N/B	2.125	470	485	52,960	2026/5/31
	US TREASURY N/B	1.875	100	101	11,104	2026/6/30
	US TREASURY N/B	1.875	590	600	65,514	2026/7/31
	US TREASURY N/B	1.5	890	884	96,506	2026/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	500	493	53,814	2026/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	400	400	43,723	2026/9/30
	US TREASURY N/B	1.625	300	300	32,784	2026/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	1,050	1,077	117,516	2026/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	800	801	87,414	2026/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	840	876	95,605	2027/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	1,080	1,137	124,069	2027/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	880	919	100,325	2027/8/15
	US TREASURY N/B	2.25	930	972	106,102	2027/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,180	1,279	139,526	2028/2/15
	US TREASURY N/B	2.875	900	986	107,538	2028/5/15
	US TREASURY N/B	5.5	120	157	17,128	2028/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	1,120	1,229	134,087	2028/8/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,070	1,198	130,688	2028/11/15
	US TREASURY N/B	5.25	310	403	44,040	2029/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	1,290	1,394	152,041	2029/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	840	890	97,160	2029/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	890	885	96,623	2029/8/15
	US TREASURY N/B	1.75	750	754	82,320	2029/11/15
	US TREASURY N/B	6.25	120	171	18,751	2030/5/15
	US TREASURY N/B	5.375	270	369	40,345	2031/2/15
	US TREASURY N/B	4.5	200	273	29,821	2036/2/15
	US TREASURY N/B	5.0	90	131	14,347	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.375	130	179	19,533	2038/2/15
	US TREASURY N/B	4.5	100	139	15,258	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	70	87	9,520	2039/2/15

銘	柄	当 期 末					
		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		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.25	240	328	35,835	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	190	268	29,276	2039/8/15
		US TREASURY N/B	4.375	200	278	30,387	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	390	560	61,118	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	260	363	39,592	2040/5/15
		US TREASURY N/B	3.875	250	328	35,779	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	210	289	31,547	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	230	337	36,806	2041/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	250	350	38,229	2041/5/15
		US TREASURY N/B	3.75	230	297	32,442	2041/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	130	153	16,781	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	180	213	23,249	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	480	557	60,793	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	300	334	36,527	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	410	457	49,906	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	590	698	76,227	2043/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	360	409	44,705	2043/5/15
		US TREASURY N/B	3.625	480	614	66,998	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.75	570	743	81,133	2043/11/15
		US TREASURY N/B	3.625	740	949	103,542	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	550	680	74,185	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	760	904	98,607	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	340	396	43,246	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	680	727	79,298	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	520	607	66,257	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	480	549	59,947	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	710	831	90,721	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	500	535	58,452	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	660	707	77,191	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	480	490	53,486	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	500	576	62,829	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	670	790	86,257	2047/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	400	472	51,495	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	800	903	98,489	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	670	756	82,543	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	460	544	59,366	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	830	1,005	109,677	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	630	747	81,488	2048/8/15
		US TREASURY N/B	3.375	460	584	63,730	2048/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	840	998	108,948	2049/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	720	837	91,321	2049/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	640	657	71,656	2049/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	560	590	64,400	2049/11/15
小	計					14,409,225	

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債還年月日	
			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	
国債証券	GOV OF CANADA	0.75	250	247	20,547	2021/3/1
	GOV OF CANADA	1.75	230	230	19,120	2021/5/1
	GOV OF CANADA	3.25	170	173	14,415	2021/6/1
	GOV OF CANADA	1.5	250	249	20,723	2021/8/1
	GOV OF CANADA	0.75	380	375	31,138	2021/9/1
	GOV OF CANADA	1.25	210	209	17,338	2021/11/1
	GOV OF CANADA	1.5	100	100	8,296	2022/2/1
	GOV OF CANADA	0.5	480	470	39,009	2022/3/1
	GOV OF CANADA	2.75	220	226	18,778	2022/6/1
	GOV OF CANADA	1.0	200	197	16,394	2022/9/1
	GOV OF CANADA	1.75	240	242	20,093	2023/3/1
	GOV OF CANADA	1.5	190	190	15,789	2023/6/1
	GOV OF CANADA	2.0	230	234	19,461	2023/9/1
	GOV OF CANADA	2.25	230	237	19,734	2024/3/1
	GOV OF CANADA	2.5	160	167	13,891	2024/6/1
	GOV OF CANADA	1.5	170	170	14,171	2024/9/1
	GOV OF CANADA	1.25	80	79	6,594	2025/3/1
	GOV OF CANADA	2.25	250	261	21,663	2025/6/1
	GOV OF CANADA	1.5	160	161	13,372	2026/6/1
	GOV OF CANADA	1.0	180	175	14,534	2027/6/1
	GOV OF CANADA	8.0	60	87	7,255	2027/6/1
	GOV OF CANADA	2.0	210	220	18,275	2028/6/1
	GOV OF CANADA	5.75	120	165	13,728	2029/6/1
	GOV OF CANADA	2.25	250	269	22,338	2029/6/1
	GOV OF CANADA	1.25	120	118	9,834	2030/6/1
	GOV OF CANADA	5.75	160	243	20,225	2033/6/1
	GOV OF CANADA	5.0	190	292	24,233	2037/6/1
	GOV OF CANADA	4.0	200	290	24,120	2041/6/1
	GOV OF CANADA	3.5	240	342	28,371	2045/12/1
	GOV OF CANADA	2.75	210	271	22,505	2048/12/1
	GOV OF CANADA	2.0	140	158	13,128	2051/12/1
	GOV OF CANADA	2.75	70	99	8,226	2064/12/1
小計					577,315	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	UNITED MEXICAN STATE	6.5	3,250	3,240	18,762	2021/6/10
	UNITED MEXICAN STATE	7.25	3,330	3,364	19,479	2021/12/9
	UNITED MEXICAN STATE	6.5	3,690	3,674	21,273	2022/6/9
	UNITED MEXICAN STATE	6.75	800	801	4,638	2023/3/9
	UNITED MEXICAN STATE	8.0	4,720	4,923	28,505	2023/12/7
	UNITED MEXICAN STATE	8.0	2,400	2,522	14,604	2024/9/5
	UNITED MEXICAN STATE	10.0	3,810	4,328	25,063	2024/12/5
	UNITED MEXICAN STATE	5.75	2,250	2,139	12,390	2026/3/5
	UNITED MEXICAN STATE	7.5	3,950	4,117	23,838	2027/6/3
	UNITED MEXICAN STATE	8.5	3,680	4,110	23,799	2029/5/31
	UNITED MEXICAN STATE	7.75	2,090	2,236	12,951	2031/5/29

銘柄			当 期 末				
			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	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	UNITED MEXICAN STATE	7.75	1,460	1,573	9,109	2034/11/23
		UNITED MEXICAN STATE	10.0	1,310	1,700	9,845	2036/11/20
		UNITED MEXICAN STATE	8.5	2,400	2,762	15,995	2038/11/18
		UNITED MEXICAN STATE	7.75	2,870	3,084	17,856	2042/11/13
		UNITED MEXICAN STATE	8.0	1,770	1,966	11,386	2047/11/7
小 計						269,501	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	2.5	320	329	39,641	2021/1/4
		GOV OF GERMANY	—	210	211	25,437	2021/3/12
		GOV OF GERMANY	—	410	412	49,681	2021/4/9
		GOV OF GERMANY	—	100	100	12,130	2021/6/11
		GOV OF GERMANY	3.25	280	295	35,558	2021/7/4
		GOV OF GERMANY	2.25	250	261	31,462	2021/9/4
		GOV OF GERMANY	—	80	80	9,719	2021/9/10
		GOV OF GERMANY	—	310	313	37,684	2021/10/8
		GOV OF GERMANY	—	110	111	13,386	2021/12/10
		GOV OF GERMANY	2.0	120	126	15,182	2022/1/4
		GOV OF GERMANY	—	350	354	42,692	2022/4/8
		GOV OF GERMANY	1.75	490	518	62,393	2022/7/4
		GOV OF GERMANY	1.5	250	264	31,761	2022/9/4
		GOV OF GERMANY	—	170	172	20,800	2022/10/7
		GOV OF GERMANY	1.5	270	287	34,627	2023/2/15
		GOV OF GERMANY	—	180	183	22,098	2023/4/14
		GOV OF GERMANY	1.5	320	342	41,239	2023/5/15
		GOV OF GERMANY	2.0	210	229	27,651	2023/8/15
		GOV OF GERMANY	—	340	347	41,861	2023/10/13
		GOV OF GERMANY	1.75	220	241	29,040	2024/2/15
		GOV OF GERMANY	—	370	379	45,660	2024/4/5
		GOV OF GERMANY	1.5	210	229	27,589	2024/5/15
		GOV OF GERMANY	1.0	290	311	37,468	2024/8/15
		GOV OF GERMANY	—	320	328	39,578	2024/10/18
		GOV OF GERMANY	0.5	380	401	48,250	2025/2/15
		GOV OF GERMANY	1.0	320	348	41,891	2025/8/15
		GOV OF GERMANY	0.5	460	489	58,891	2026/2/15
		GOV OF GERMANY	—	260	269	32,361	2026/8/15
		GOV OF GERMANY	0.25	510	537	64,657	2027/2/15
		GOV OF GERMANY	6.5	140	214	25,744	2027/7/4
		GOV OF GERMANY	0.5	270	290	34,929	2027/8/15
		GOV OF GERMANY	5.625	170	253	30,525	2028/1/4
		GOV OF GERMANY	0.5	250	269	32,433	2028/2/15
		GOV OF GERMANY	4.75	190	274	33,054	2028/7/4
		GOV OF GERMANY	0.25	280	296	35,682	2028/8/15
		GOV OF GERMANY	0.25	440	466	56,114	2029/2/15
		GOV OF GERMANY	—	170	176	21,179	2029/8/15
		GOV OF GERMANY	6.25	210	351	42,238	2030/1/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	5.5	250	412	49,624	2031/1/4
		GOV OF GERMANY	4.75	240	414	49,822	2034/7/4
		GOV OF GERMANY	4.0	290	493	59,331	2037/1/4
		GOV OF GERMANY	4.25	260	477	57,485	2039/7/4
		GOV OF GERMANY	4.75	220	435	52,355	2040/7/4
		GOV OF GERMANY	3.25	270	464	55,823	2042/7/4
		GOV OF GERMANY	2.5	390	618	74,361	2044/7/4
		GOV OF GERMANY	2.5	340	551	66,289	2046/8/15
		GOV OF GERMANY	1.25	300	391	47,108	2048/8/15
		GOV OF GERMANY	—	60	56	6,817	2050/8/15
イタリア	国債証券	GOV OF ITALY	3.75	310	323	38,934	2021/3/1
		GOV OF ITALY	0.05	50	50	6,032	2021/4/15
		GOV OF ITALY	3.75	400	419	50,504	2021/5/1
		GOV OF ITALY	0.45	80	80	9,703	2021/6/1
		GOV OF ITALY	3.75	390	412	49,660	2021/8/1
		GOV OF ITALY	4.75	420	452	54,427	2021/9/1
		GOV OF ITALY	2.3	280	291	35,052	2021/10/15
		GOV OF ITALY	0.35	140	141	16,964	2021/11/1
		GOV OF ITALY	2.15	350	364	43,851	2021/12/15
		GOV OF ITALY	5.0	210	232	27,920	2022/3/1
		GOV OF ITALY	1.2	120	123	14,809	2022/4/1
		GOV OF ITALY	1.35	190	195	23,519	2022/4/15
		GOV OF ITALY	1.0	250	255	30,765	2022/7/15
		GOV OF ITALY	0.9	640	653	78,586	2022/8/1
		GOV OF ITALY	5.5	230	262	31,557	2022/9/1
		GOV OF ITALY	1.45	120	124	14,949	2022/9/15
		GOV OF ITALY	5.5	340	390	46,935	2022/11/1
		GOV OF ITALY	0.05	210	209	25,165	2023/1/15
		GOV OF ITALY	0.95	240	245	29,531	2023/3/1
		GOV OF ITALY	0.95	240	245	29,541	2023/3/15
		GOV OF ITALY	4.5	390	443	53,395	2023/5/1
		GOV OF ITALY	4.75	340	393	47,298	2023/8/1
		GOV OF ITALY	2.45	300	323	38,892	2023/10/1
		GOV OF ITALY	0.65	200	202	24,402	2023/10/15
		GOV OF ITALY	4.5	460	536	64,497	2024/3/1
		GOV OF ITALY	1.85	170	180	21,675	2024/5/15
		GOV OF ITALY	1.75	200	211	25,404	2024/7/1
		GOV OF ITALY	3.75	370	424	51,053	2024/9/1
		GOV OF ITALY	1.45	180	187	22,612	2024/11/15
		GOV OF ITALY	2.5	380	415	49,982	2024/12/1
		GOV OF ITALY	5.0	290	354	42,600	2025/3/1
		GOV OF ITALY	1.45	200	208	25,078	2025/5/15
GOV OF ITALY	1.5	320	334	40,239	2025/6/1		
GOV OF ITALY	2.5	220	242	29,139	2025/11/15		
GOV OF ITALY	2.0	450	483	58,142	2025/12/1		

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	GOV OF ITALY	4.5	390	477	57,423	2026/3/1
		GOV OF ITALY	1.6	250	263	31,643	2026/6/1
		GOV OF ITALY	2.1	300	324	39,024	2026/7/15
		GOV OF ITALY	1.25	330	339	40,842	2026/12/1
		GOV OF ITALY	0.85	40	39	4,805	2027/1/15
		GOV OF ITALY	2.2	310	338	40,693	2027/6/1
		GOV OF ITALY	2.05	310	335	40,301	2027/8/1
		GOV OF ITALY	6.5	350	494	59,534	2027/11/1
		GOV OF ITALY	2.0	280	302	36,377	2028/2/1
		GOV OF ITALY	4.75	390	508	61,201	2028/9/1
		GOV OF ITALY	2.8	210	240	28,951	2028/12/1
		GOV OF ITALY	3.0	210	245	29,500	2029/8/1
		GOV OF ITALY	5.25	510	700	84,296	2029/11/1
		GOV OF ITALY	3.5	370	449	54,123	2030/3/1
		GOV OF ITALY	1.35	120	121	14,615	2030/4/1
		GOV OF ITALY	6.0	470	698	84,079	2031/5/1
		GOV OF ITALY	1.65	340	350	42,112	2032/3/1
		GOV OF ITALY	5.75	320	479	57,649	2033/2/1
		GOV OF ITALY	2.45	180	199	24,050	2033/9/1
		GOV OF ITALY	5.0	350	501	60,294	2034/8/1
		GOV OF ITALY	3.35	150	182	22,002	2035/3/1
		GOV OF ITALY	2.25	120	128	15,495	2036/9/1
		GOV OF ITALY	4.0	480	632	76,074	2037/2/1
		GOV OF ITALY	2.95	160	186	22,405	2038/9/1
		GOV OF ITALY	5.0	410	611	73,559	2039/8/1
		GOV OF ITALY	3.1	130	153	18,432	2040/3/1
GOV OF ITALY	5.0	270	403	48,499	2040/9/1		
GOV OF ITALY	4.75	260	387	46,580	2044/9/1		
GOV OF ITALY	3.25	260	315	38,005	2046/9/1		
GOV OF ITALY	2.7	260	287	34,624	2047/3/1		
GOV OF ITALY	3.45	290	364	43,821	2048/3/1		
GOV OF ITALY	3.85	120	160	19,294	2049/9/1		
GOV OF ITALY	2.8	120	130	15,701	2067/3/1		
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	—	550	553	66,578	2021/2/25
		GOV OF FRANCE	3.75	590	621	74,817	2021/4/25
		GOV OF FRANCE	—	290	292	35,156	2021/5/25
		GOV OF FRANCE	3.25	480	512	61,630	2021/10/25
		GOV OF FRANCE	—	270	273	32,867	2022/2/25
		GOV OF FRANCE	3.0	800	864	104,038	2022/4/25
		GOV OF FRANCE	—	270	273	32,922	2022/5/25
		GOV OF FRANCE	2.25	670	722	86,894	2022/10/25
		GOV OF FRANCE	—	600	610	73,466	2023/3/25
		GOV OF FRANCE	1.75	710	764	92,018	2023/5/25
		GOV OF FRANCE	4.25	640	756	90,951	2023/10/25
		GOV OF FRANCE	—	190	194	23,338	2024/3/25

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	2.25	660	739	88,957	2024/5/25
		GOV OF FRANCE	1.75	640	709	85,300	2024/11/25
		GOV OF FRANCE	—	480	490	58,989	2025/3/25
		GOV OF FRANCE	0.5	610	640	77,046	2025/5/25
		GOV OF FRANCE	6.0	340	466	56,068	2025/10/25
		GOV OF FRANCE	1.0	460	497	59,818	2025/11/25
		GOV OF FRANCE	3.5	630	783	94,246	2026/4/25
		GOV OF FRANCE	0.5	490	516	62,089	2026/5/25
		GOV OF FRANCE	0.25	430	446	53,689	2026/11/25
		GOV OF FRANCE	1.0	350	382	46,047	2027/5/25
		GOV OF FRANCE	2.75	670	827	99,592	2027/10/25
		GOV OF FRANCE	0.75	420	453	54,557	2028/5/25
		GOV OF FRANCE	0.75	560	605	72,834	2028/11/25
		GOV OF FRANCE	5.5	620	947	113,989	2029/4/25
		GOV OF FRANCE	0.5	570	603	72,549	2029/5/25
		GOV OF FRANCE	2.5	660	834	100,441	2030/5/25
		GOV OF FRANCE	1.5	600	700	84,304	2031/5/25
		GOV OF FRANCE	5.75	490	844	101,542	2032/10/25
		GOV OF FRANCE	1.25	270	310	37,313	2034/5/25
		GOV OF FRANCE	4.75	410	688	82,865	2035/4/25
		GOV OF FRANCE	1.25	440	505	60,805	2036/5/25
		GOV OF FRANCE	4.0	480	795	95,726	2038/10/25
		GOV OF FRANCE	1.75	240	299	36,030	2039/6/25
		GOV OF FRANCE	4.5	490	890	107,075	2041/4/25
		GOV OF FRANCE	3.25	370	599	72,168	2045/5/25
		GOV OF FRANCE	2.0	360	482	57,989	2048/5/25
GOV OF FRANCE	1.5	310	373	44,927	2050/5/25		
GOV OF FRANCE	4.0	280	555	66,865	2055/4/25		
GOV OF FRANCE	4.0	220	457	55,073	2060/4/25		
GOV OF FRANCE	1.75	180	238	28,724	2066/5/25		
オランダ	国債証券	GOV OF NETHERLANDS	3.25	240	253	30,516	2021/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	—	150	151	18,258	2022/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.25	260	278	33,515	2022/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	3.75	260	293	35,366	2023/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	1.75	230	248	29,939	2023/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	—	130	132	15,983	2024/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.0	290	323	38,875	2024/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.25	180	187	22,518	2025/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.5	240	254	30,611	2026/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.75	240	260	31,282	2027/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	5.5	220	323	38,961	2028/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.75	140	152	18,375	2028/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.25	190	198	23,927	2029/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.5	190	254	30,587	2033/1/15
GOV OF NETHERLANDS	4.0	220	367	44,229	2037/1/15		

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	GOV OF NETHERLANDS	0.5	110	117	14,179	2040/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	3.75	230	411	49,512	2042/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.75	210	351	42,344	2047/1/15
スペイン	国債証券	GOV OF SPAIN	0.05	330	331	39,903	2021/1/31
		GOV OF SPAIN	5.5	280	300	36,191	2021/4/30
		GOV OF SPAIN	0.75	300	305	36,736	2021/7/30
		GOV OF SPAIN	0.05	280	282	33,939	2021/10/31
		GOV OF SPAIN	5.85	330	371	44,684	2022/1/31
		GOV OF SPAIN	0.4	300	305	36,717	2022/4/30
		GOV OF SPAIN	0.45	230	234	28,268	2022/10/31
		GOV OF SPAIN	5.4	340	398	47,925	2023/1/31
		GOV OF SPAIN	0.35	270	275	33,159	2023/7/30
		GOV OF SPAIN	4.4	310	364	43,796	2023/10/31
		GOV OF SPAIN	4.8	250	300	36,116	2024/1/31
		GOV OF SPAIN	3.8	280	327	39,391	2024/4/30
		GOV OF SPAIN	0.25	250	254	30,618	2024/7/30
		GOV OF SPAIN	2.75	380	432	52,018	2024/10/31
		GOV OF SPAIN	1.6	330	359	43,215	2025/4/30
		GOV OF SPAIN	4.65	400	503	60,566	2025/7/30
		GOV OF SPAIN	2.15	230	258	31,139	2025/10/31
		GOV OF SPAIN	1.95	230	257	30,996	2026/4/30
		GOV OF SPAIN	5.9	400	551	66,373	2026/7/30
		GOV OF SPAIN	1.3	230	249	29,962	2026/10/31
		GOV OF SPAIN	1.5	320	351	42,326	2027/4/30
		GOV OF SPAIN	1.45	300	329	39,650	2027/10/31
		GOV OF SPAIN	1.4	360	394	47,487	2028/4/30
		GOV OF SPAIN	1.4	140	153	18,479	2028/7/30
		GOV OF SPAIN	5.15	320	455	54,779	2028/10/31
		GOV OF SPAIN	6.0	340	513	61,726	2029/1/31
		GOV OF SPAIN	1.45	290	320	38,497	2029/4/30
		GOV OF SPAIN	0.6	390	399	48,048	2029/10/31
		GOV OF SPAIN	1.95	330	382	45,972	2030/7/30
		GOV OF SPAIN	5.75	410	670	80,635	2032/7/30
GOV OF SPAIN	2.35	170	207	24,990	2033/7/30		
GOV OF SPAIN	1.85	180	208	25,062	2035/7/30		
GOV OF SPAIN	4.2	260	400	48,230	2037/1/31		
GOV OF SPAIN	4.9	300	520	62,601	2040/7/30		
GOV OF SPAIN	4.7	210	359	43,301	2041/7/30		
GOV OF SPAIN	5.15	250	468	56,304	2044/10/31		
GOV OF SPAIN	2.9	240	332	40,034	2046/10/31		
GOV OF SPAIN	2.7	200	269	32,444	2048/10/31		
GOV OF SPAIN	3.45	180	292	35,136	2066/7/30		
ベルギー	国債証券	GOV OF BELGIUM	4.25	270	291	35,120	2021/9/28
		GOV OF BELGIUM	4.0	100	110	13,237	2022/3/28
		GOV OF BELGIUM	4.25	280	316	38,057	2022/9/28

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	GOV OF BELGIUM	2.25	160	175	21,098	2023/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.2	140	143	17,293	2023/10/22
		GOV OF BELGIUM	2.6	210	238	28,708	2024/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.5	150	156	18,843	2024/10/22
		GOV OF BELGIUM	0.8	270	287	34,570	2025/6/22
		GOV OF BELGIUM	4.5	160	208	25,061	2026/3/28
		GOV OF BELGIUM	1.0	190	206	24,791	2026/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.8	200	215	25,915	2027/6/22
		GOV OF BELGIUM	5.5	290	426	51,311	2028/3/28
		GOV OF BELGIUM	0.8	190	205	24,731	2028/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.9	160	175	21,054	2029/6/22
		GOV OF BELGIUM	1.0	220	243	29,334	2031/6/22
		GOV OF BELGIUM	4.0	120	177	21,340	2032/3/28
		GOV OF BELGIUM	1.25	40	45	5,512	2033/4/22
		GOV OF BELGIUM	3.0	140	195	23,566	2034/6/22
		GOV OF BELGIUM	5.0	270	460	55,444	2035/3/28
		GOV OF BELGIUM	1.45	90	106	12,755	2037/6/22
		GOV OF BELGIUM	1.9	130	163	19,710	2038/6/22
		GOV OF BELGIUM	4.25	260	455	54,756	2041/3/28
		GOV OF BELGIUM	3.75	160	278	33,508	2045/6/22
GOV OF BELGIUM	1.6	120	148	17,816	2047/6/22		
GOV OF BELGIUM	1.7	90	113	13,621	2050/6/22		
GOV OF BELGIUM	2.25	70	101	12,219	2057/6/22		
GOV OF BELGIUM	2.15	70	102	12,386	2066/6/22		
オーストリア	国債証券	GOV OF AUSTRIA	3.5	120	128	15,409	2021/9/15
		GOV OF AUSTRIA	3.65	160	175	21,087	2022/4/20
		GOV OF AUSTRIA	—	210	213	25,657	2022/9/20
		GOV OF AUSTRIA	3.4	60	66	8,036	2022/11/22
		GOV OF AUSTRIA	—	170	173	20,840	2023/7/15
		GOV OF AUSTRIA	1.75	210	228	27,443	2023/10/20
		GOV OF AUSTRIA	—	30	30	3,686	2024/7/15
		GOV OF AUSTRIA	1.65	140	154	18,552	2024/10/21
		GOV OF AUSTRIA	1.2	240	262	31,544	2025/10/20
		GOV OF AUSTRIA	4.85	160	211	25,487	2026/3/15
		GOV OF AUSTRIA	0.75	110	118	14,200	2026/10/20
		GOV OF AUSTRIA	0.5	180	190	22,914	2027/4/20
		GOV OF AUSTRIA	6.25	130	194	23,377	2027/7/15
		GOV OF AUSTRIA	0.75	100	107	12,991	2028/2/20
		GOV OF AUSTRIA	0.5	110	116	14,029	2029/2/20
		GOV OF AUSTRIA	2.4	110	145	17,521	2034/5/23
		GOV OF AUSTRIA	4.15	210	350	42,123	2037/3/15
		GOV OF AUSTRIA	3.15	100	165	19,864	2044/6/20
		GOV OF AUSTRIA	1.5	100	126	15,243	2047/2/20
		GOV OF AUSTRIA	3.8	60	131	15,775	2062/1/26
GOV OF AUSTRIA	1.5	50	67	8,110	2086/11/2		

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	GOV OF AUSTRIA	2.1	74	130	15,647	2117/9/20
フィンランド	国債証券	GOV OF FINLAND	3.5	100	105	12,633	2021/4/15
		GOV OF FINLAND	—	80	81	9,750	2022/4/15
		GOV OF FINLAND	1.625	90	95	11,461	2022/9/15
		GOV OF FINLAND	1.5	90	96	11,551	2023/4/15
		GOV OF FINLAND	—	20	20	2,453	2023/9/15
		GOV OF FINLAND	2.0	90	99	11,983	2024/4/15
		GOV OF FINLAND	—	50	51	6,145	2024/9/15
		GOV OF FINLAND	4.0	80	99	11,976	2025/7/4
		GOV OF FINLAND	0.875	30	32	3,868	2025/9/15
		GOV OF FINLAND	0.5	80	84	10,135	2026/4/15
		GOV OF FINLAND	0.5	90	95	11,456	2027/9/15
		GOV OF FINLAND	2.75	60	75	9,045	2028/7/4
		GOV OF FINLAND	0.5	60	63	7,657	2028/9/15
		GOV OF FINLAND	0.5	80	84	10,215	2029/9/15
		GOV OF FINLAND	0.75	60	65	7,853	2031/4/15
GOV OF FINLAND	1.125	60	68	8,261	2034/4/15		
GOV OF FINLAND	2.625	70	105	12,721	2042/7/4		
GOV OF FINLAND	1.375	50	62	7,559	2047/4/15		
アイルランド	国債証券	GOV OF IRELAND	0.8	80	82	9,891	2022/3/15
		GOV OF IRELAND	—	80	81	9,755	2022/10/18
		GOV OF IRELAND	3.9	120	136	16,441	2023/3/20
		GOV OF IRELAND	3.4	150	173	20,929	2024/3/18
		GOV OF IRELAND	5.4	160	207	24,966	2025/3/13
		GOV OF IRELAND	1.0	140	151	18,202	2026/5/15
		GOV OF IRELAND	0.9	120	130	15,700	2028/5/15
		GOV OF IRELAND	1.1	120	133	16,019	2029/5/15
		GOV OF IRELAND	2.4	120	149	18,014	2030/5/15
		GOV OF IRELAND	1.35	100	114	13,742	2031/3/18
		GOV OF IRELAND	1.3	60	68	8,257	2033/5/15
		GOV OF IRELAND	1.7	90	109	13,170	2037/5/15
		GOV OF IRELAND	2.0	140	185	22,341	2045/2/18
GOV OF IRELAND	1.5	50	60	7,236	2050/5/15		
小 計						11,061,620	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY		1.5	340	343	48,939	2021/1/22
	UK TREASURY		3.75	430	452	64,554	2021/9/7
	UK TREASURY		4.0	180	193	27,602	2022/3/7
	UK TREASURY		0.5	270	270	38,605	2022/7/22
	UK TREASURY		1.75	440	455	64,963	2022/9/7
	UK TREASURY		0.75	290	293	41,854	2023/7/22
	UK TREASURY		2.25	290	309	44,100	2023/9/7
	UK TREASURY		1.0	380	389	55,550	2024/4/22
	UK TREASURY		2.75	140	155	22,104	2024/9/7
	UK TREASURY		5.0	250	308	43,932	2025/3/7

銘柄	当期末					
	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	
国債証券	UK TREASURY	0.625	150	151	21,611	2025/6/7
	UK TREASURY	2.0	240	261	37,325	2025/9/7
	UK TREASURY	1.5	240	256	36,624	2026/7/22
	UK TREASURY	1.25	180	190	27,188	2027/7/22
	UK TREASURY	4.25	240	310	44,288	2027/12/7
	UK TREASURY	1.625	430	471	67,245	2028/10/22
	UK TREASURY	6.0	170	251	35,822	2028/12/7
	UK TREASURY	0.875	230	236	33,744	2029/10/22
	UK TREASURY	4.75	240	345	49,182	2030/12/7
	UK TREASURY	4.25	130	184	26,315	2032/6/7
	UK TREASURY	4.5	210	316	45,155	2034/9/7
	UK TREASURY	4.25	300	451	64,392	2036/3/7
	UK TREASURY	1.75	390	439	62,681	2037/9/7
	UK TREASURY	4.75	250	414	59,063	2038/12/7
	UK TREASURY	4.25	190	300	42,888	2039/9/7
	UK TREASURY	4.25	220	353	50,442	2040/12/7
	UK TREASURY	4.5	320	545	77,769	2042/12/7
	UK TREASURY	3.25	310	453	64,628	2044/1/22
	UK TREASURY	3.5	310	475	67,790	2045/1/22
	UK TREASURY	4.25	330	575	82,038	2046/12/7
	UK TREASURY	1.5	220	242	34,613	2047/7/22
	UK TREASURY	1.75	160	187	26,698	2049/1/22
	UK TREASURY	4.25	240	436	62,191	2049/12/7
	UK TREASURY	3.75	240	421	60,087	2052/7/22
	UK TREASURY	1.625	110	130	18,530	2054/10/22
	UK TREASURY	4.25	280	555	79,189	2055/12/7
	UK TREASURY	1.75	230	286	40,856	2057/7/22
	UK TREASURY	4.0	260	522	74,496	2060/1/22
	UK TREASURY	2.5	240	377	53,748	2065/7/22
	UK TREASURY	3.5	220	436	62,239	2068/7/22
	UK TREASURY	1.625	140	179	25,642	2071/10/22
小計					1,986,701	
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		
国債証券	GOV OF SWEDEN	3.5	1,650	1,798	20,501	2022/6/1
	GOV OF SWEDEN	1.5	1,180	1,259	14,360	2023/11/13
	GOV OF SWEDEN	2.5	930	1,064	12,133	2025/5/12
	GOV OF SWEDEN	1.0	1,030	1,109	12,646	2026/11/12
	GOV OF SWEDEN	0.75	660	704	8,028	2028/5/12
	GOV OF SWEDEN	0.75	750	800	9,124	2029/11/12
	GOV OF SWEDEN	3.5	720	1,121	12,787	2039/3/30
小計					89,582	
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		
国債証券	GOV OF NORWAY	3.75	1,310	1,351	16,286	2021/5/25
	GOV OF NORWAY	2.0	1,100	1,125	13,561	2023/5/24
	GOV OF NORWAY	3.0	810	865	10,432	2024/3/14

銘	柄	当 期 末					
		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	国債証券	GOV OF NORWAY	%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
		GOV OF NORWAY	1.75	450	460	5,553	2025/3/13
		GOV OF NORWAY	1.5	620	628	7,570	2026/2/19
		GOV OF NORWAY	1.75	490	505	6,086	2027/2/17
		GOV OF NORWAY	2.0	640	674	8,122	2028/4/26
		GOV OF NORWAY	1.75	430	445	5,371	2029/9/6
小 計					72,985		
デンマーク	国債証券	GOV OF DENMARK		千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
		GOV OF DENMARK	3.0	1,030	1,098	17,684	2021/11/15
		GOV OF DENMARK	1.5	930	1,005	16,188	2023/11/15
		GOV OF DENMARK	1.75	920	1,043	16,806	2025/11/15
		GOV OF DENMARK	0.5	1,300	1,398	22,510	2027/11/15
		GOV OF DENMARK	0.5	660	713	11,494	2029/11/15
GOV OF DENMARK	4.5	1,810	3,451	55,563	2039/11/15		
小 計					140,248		
ポーランド	国債証券	GOV OF POLAND		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
		GOV OF POLAND	2.0	170	171	4,841	2021/4/25
		GOV OF POLAND	—	360	353	9,989	2021/5/25
		GOV OF POLAND	1.75	480	481	13,619	2021/7/25
		GOV OF POLAND	5.75	180	192	5,456	2021/10/25
		GOV OF POLAND	2.25	570	578	16,346	2022/4/25
		GOV OF POLAND	5.75	310	342	9,686	2022/9/23
		GOV OF POLAND	2.5	580	593	16,764	2023/1/25
		GOV OF POLAND	4.0	270	291	8,238	2023/10/25
		GOV OF POLAND	2.5	510	523	14,800	2024/4/25
		GOV OF POLAND	2.25	100	101	2,869	2024/10/25
		GOV OF POLAND	3.25	480	510	14,428	2025/7/25
		GOV OF POLAND	2.5	510	521	14,738	2026/7/25
		GOV OF POLAND	2.5	530	540	15,280	2027/7/25
		GOV OF POLAND	2.75	380	394	11,143	2028/4/25
GOV OF POLAND	5.75	170	222	6,277	2029/4/25		
GOV OF POLAND	2.75	280	292	8,262	2029/10/25		
小 計					172,744		
オーストラリア	国債証券	GOV OF AUSTRALIA		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
		GOV OF AUSTRALIA	5.75	350	372	27,660	2021/5/15
		GOV OF AUSTRALIA	2.0	230	235	17,488	2021/12/21
		GOV OF AUSTRALIA	5.75	410	460	34,193	2022/7/15
		GOV OF AUSTRALIA	2.25	180	187	13,940	2022/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	5.5	370	426	31,655	2023/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	410	443	32,947	2024/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.25	420	471	35,042	2025/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	4.25	500	601	44,666	2026/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	4.75	400	505	37,561	2027/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	470	531	39,491	2027/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.25	310	339	25,259	2028/5/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	470	536	39,873	2028/11/21

銘柄	当 期 末					
	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		
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	
国債証券	GOV OF AUSTRALIA	3.25	380	452	33,614	2029/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.75	440	507	37,741	2029/11/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.5	360	408	30,382	2030/5/21
	GOV OF AUSTRALIA	1.5	220	228	16,979	2031/6/21
	GOV OF AUSTRALIA	4.5	240	337	25,060	2033/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.75	140	168	12,495	2035/6/21
	GOV OF AUSTRALIA	3.75	110	149	11,116	2037/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	3.25	150	194	14,440	2039/6/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.75	70	84	6,294	2041/5/21
	GOV OF AUSTRALIA	3.0	180	231	17,178	2047/3/21
小 計					585,085	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	GOV OF SINGAPORE	2.25	90	91	7,335	2021/6/1
	GOV OF SINGAPORE	1.25	130	129	10,452	2021/10/1
	GOV OF SINGAPORE	1.75	30	30	2,436	2022/4/1
	GOV OF SINGAPORE	3.125	130	135	10,937	2022/9/1
	GOV OF SINGAPORE	1.75	70	70	5,701	2023/2/1
	GOV OF SINGAPORE	2.75	80	83	6,735	2023/7/1
	GOV OF SINGAPORE	2.0	60	61	4,946	2024/2/1
	GOV OF SINGAPORE	3.0	70	74	6,030	2024/9/1
	GOV OF SINGAPORE	2.375	70	73	5,905	2025/6/1
	GOV OF SINGAPORE	2.125	50	51	4,181	2026/6/1
	GOV OF SINGAPORE	3.5	110	124	10,028	2027/3/1
	GOV OF SINGAPORE	2.625	70	75	6,093	2028/5/1
	GOV OF SINGAPORE	2.875	70	77	6,245	2029/7/1
	GOV OF SINGAPORE	2.875	90	100	8,078	2030/9/1
	GOV OF SINGAPORE	3.375	80	95	7,688	2033/9/1
	GOV OF SINGAPORE	2.25	50	52	4,265	2036/8/1
	GOV OF SINGAPORE	2.375	40	43	3,488	2039/7/1
	GOV OF SINGAPORE	2.75	70	79	6,446	2042/4/1
	GOV OF SINGAPORE	2.75	90	103	8,303	2046/3/1
小 計					125,301	
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		
国債証券	GOV OF MALAYSIA	4.16	110	112	3,011	2021/7/15
	GOV OF MALAYSIA	4.048	220	224	6,033	2021/9/30
	GOV OF MALAYSIA	3.62	200	203	5,454	2021/11/30
	GOV OF MALAYSIA	3.882	140	142	3,841	2022/3/10
	GOV OF MALAYSIA	3.418	140	141	3,813	2022/8/15
	GOV OF MALAYSIA	3.795	130	132	3,572	2022/9/30
	GOV OF MALAYSIA	3.48	160	162	4,377	2023/3/15
	GOV OF MALAYSIA	3.757	100	102	2,761	2023/4/20
	GOV OF MALAYSIA	3.8	120	123	3,323	2023/8/17
	GOV OF MALAYSIA	3.478	170	173	4,668	2024/6/14
	GOV OF MALAYSIA	4.181	200	210	5,647	2024/7/15
	GOV OF MALAYSIA	4.059	100	104	2,813	2024/9/30

銘	柄	当 期 末					
		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		
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		
	国債証券	GOV OF MALAYSIA	3.882	100	104	2,799	2025/3/14
		GOV OF MALAYSIA	3.955	190	198	5,345	2025/9/15
		GOV OF MALAYSIA	4.392	190	204	5,482	2026/4/15
		GOV OF MALAYSIA	3.906	80	83	2,251	2026/7/15
		GOV OF MALAYSIA	3.9	240	251	6,756	2026/11/30
		GOV OF MALAYSIA	3.502	100	102	2,752	2027/5/31
		GOV OF MALAYSIA	3.899	230	242	6,502	2027/11/16
		GOV OF MALAYSIA	3.733	260	270	7,269	2028/6/15
		GOV OF MALAYSIA	3.885	190	201	5,408	2029/8/15
		GOV OF MALAYSIA	4.498	250	277	7,442	2030/4/15
		GOV OF MALAYSIA	4.232	210	228	6,139	2031/6/30
		GOV OF MALAYSIA	3.844	340	359	9,651	2033/4/15
		GOV OF MALAYSIA	4.642	40	45	1,230	2033/11/7
		GOV OF MALAYSIA	3.828	100	106	2,871	2034/7/5
		GOV OF MALAYSIA	4.254	70	77	2,087	2035/5/31
		GOV OF MALAYSIA	4.762	180	211	5,692	2037/4/7
		GOV OF MALAYSIA	4.893	120	143	3,861	2038/6/8
		GOV OF MALAYSIA	4.935	140	166	4,484	2043/9/30
		GOV OF MALAYSIA	4.736	80	92	2,478	2046/3/15
		GOV OF MALAYSIA	4.921	150	179	4,819	2048/7/6
小	計					144,647	
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	GOV OF SOUTH AFRICA	6.75	940	942	7,122	2021/3/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	7.75	1,010	1,035	7,825	2023/2/28
		GOV OF SOUTH AFRICA	10.5	3,900	4,385	33,157	2026/12/21
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.0	2,340	2,185	16,519	2030/1/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	7.0	1,940	1,646	12,446	2031/2/28
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.25	1,340	1,228	9,286	2032/3/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.875	1,990	1,849	13,985	2035/2/28
		GOV OF SOUTH AFRICA	6.25	930	664	5,023	2036/3/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.5	1,990	1,753	13,260	2037/1/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	9.0	1,580	1,436	10,862	2040/1/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	6.5	1,060	736	5,570	2041/2/28
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.75	1,950	1,706	12,902	2044/1/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.75	3,770	3,287	24,850	2048/2/28
小	計					172,812	
合	計					29,807,773	

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	29,807,773	97.5
コール・ローン等、その他	772,936	2.5
投資信託財産総額	30,580,709	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産(30,468,967千円)の投資信託財産総額(30,580,709千円)に対する比率は99.6%です。

(注) 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。1米ドル=109.06円、1カナダドル=82.94円、1メキシコペソ=5.79円、1ユーロ=120.30円、1英ポンド=142.51円、1スウェーデンクローナ=11.40円、1ノルウェークローネ=12.05円、1デンマーククローネ=16.10円、1ポーランドズロチ=28.27円、1オーストラリアドル=74.30円、1シンガポールドル=80.60円、1マレーシアリングギット=26.87円、1南アフリカランド=7.56円。

○特定資産の価格等の調査

(2019年1月26日～2020年1月27日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	30,976,429,018	
コール・ローン等	141,583,899	
公社債(評価額)	29,807,773,813	
未収入金	790,967,140	
未収利息	216,261,916	
前払費用	19,842,250	
(B) 負債	890,168,164	
未払金	460,088,042	
未払解約金	430,080,000	
未払利息	122	
(C) 純資産総額(A-B)	30,086,260,854	
元本	29,562,938,389	
次期繰越損益金	523,322,465	
(D) 受益権総口数	29,562,938,389口	
1万口当たり基準価額(C/D)	10,177円	

(注) 当ファンドの期首元本額は32,538,384,108円、期中追加設定元本額は12,342,361,668円、期中一部解約元本額は15,317,807,387円です。

(注) 2020年1月27日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	23,995,654,885円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	3,285,160,939円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	422,099,426円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	404,383,354円
・つみたてバランスファンド	273,889,167円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	217,977,583円
・Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	190,026,975円
・FWりそな先進国債券アクティブファンド	161,067,295円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	125,607,605円
・FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	97,683,258円
・りそなFT 先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	92,942,281円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	80,860,733円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	80,653,433円
・DCりそな グローバルバランス	78,261,686円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	33,067,898円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	16,533,679円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	5,057,271円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	1,354,516円
・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	548,318円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	108,087円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0177円です。

○損益の状況 (2019年1月26日～2020年1月27日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	699,003,132	
受取利息	699,212,242	
支払利息	△ 209,110	
(B) 有価証券売買損益	1,158,646,743	
売買益	2,255,566,701	
売買損	△1,096,919,958	
(C) 保管費用等	△ 7,828,171	
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,849,821,704	
(E) 前期繰越損益金	△1,353,993,358	
(F) 追加信託差損益金	△ 112,712,268	
(G) 解約差損益金	140,206,387	
(H) 計(D+E+F+G)	523,322,465	
次期繰越損益金(H)	523,322,465	

(注) 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) 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) 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。

○お知らせ

該当事項はございません。