

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年4月10日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	上場インデックスファンド海外債券（FTSE WGBI）毎月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	30兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書を提出しましたので2019年10月10日付をもって提出しました有価証券届出書（2020年1月15日付で有価証券届出書の訂正届出書を提出済み。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (3)【ファンドの仕組み】

&lt;更新後&gt;

委託会社の概況（2020年1月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

## 3) 大株主の状況

名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

## 2【投資方針】

## (2)【投資対象】

&lt;更新後&gt;

投資対象とする投資信託証券の概要

&lt;海外債券インデックスファンド（適格機関投資家向け）&gt;

運用の基本方針	
基本方針	安定した収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	世界各国の債券などを主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として、世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）<sup>*</sup>の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に採用されていない債券についても、国際機関債など信用力が相対的に高い債券に投資を行なう場合があります。また、「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券に投資する場合やFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に採用されている債券の一部または全部の値動きに連動をめざす上場投資信託証券に投資する場合があります。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>・投資信託証券（マザーファンド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、信託財産の総額の5%以下とします。</li> <li>・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	<p>第1計算期から第4計算期までは、収益分配を行ないません。第5計算期以降、毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。</p>
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.11%（税抜0.1%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> <li>・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額</li> <li>・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）</li> </ul>
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）

その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> <li>運用報告書などの作成および交付に係る費用、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。</li> <li>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
----------	--

### その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限(2009年9月28日設定)
決算日	毎月6日(休業日の場合は翌営業日)

\* FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(ご参考) < 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は行ないません。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

## &lt; マネー・オープン・マザーファンド &gt;

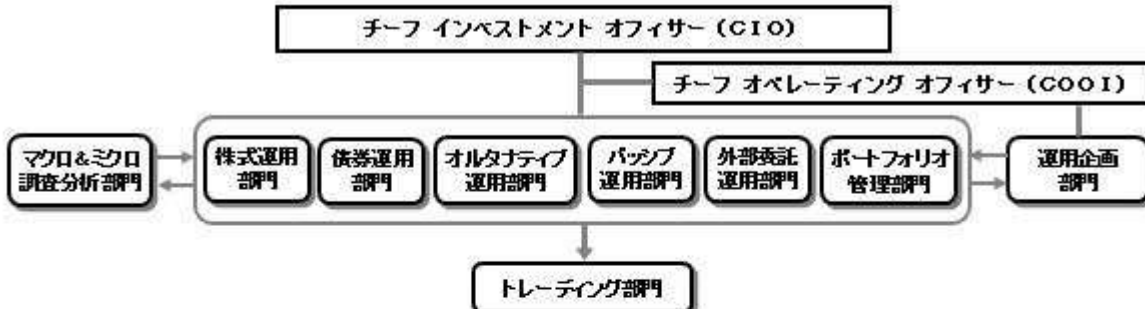
運用の基本方針	
基本方針	公社債への投資により、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の国債および格付の高い公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>わが国の国債および格付の高い公社債に投資を行ない、利息等収益の確保をめざして運用を行ないます。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、当該比率を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社

受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2003年3月28日設定）
決算日	毎年1月15日（休業日の場合は翌営業日）

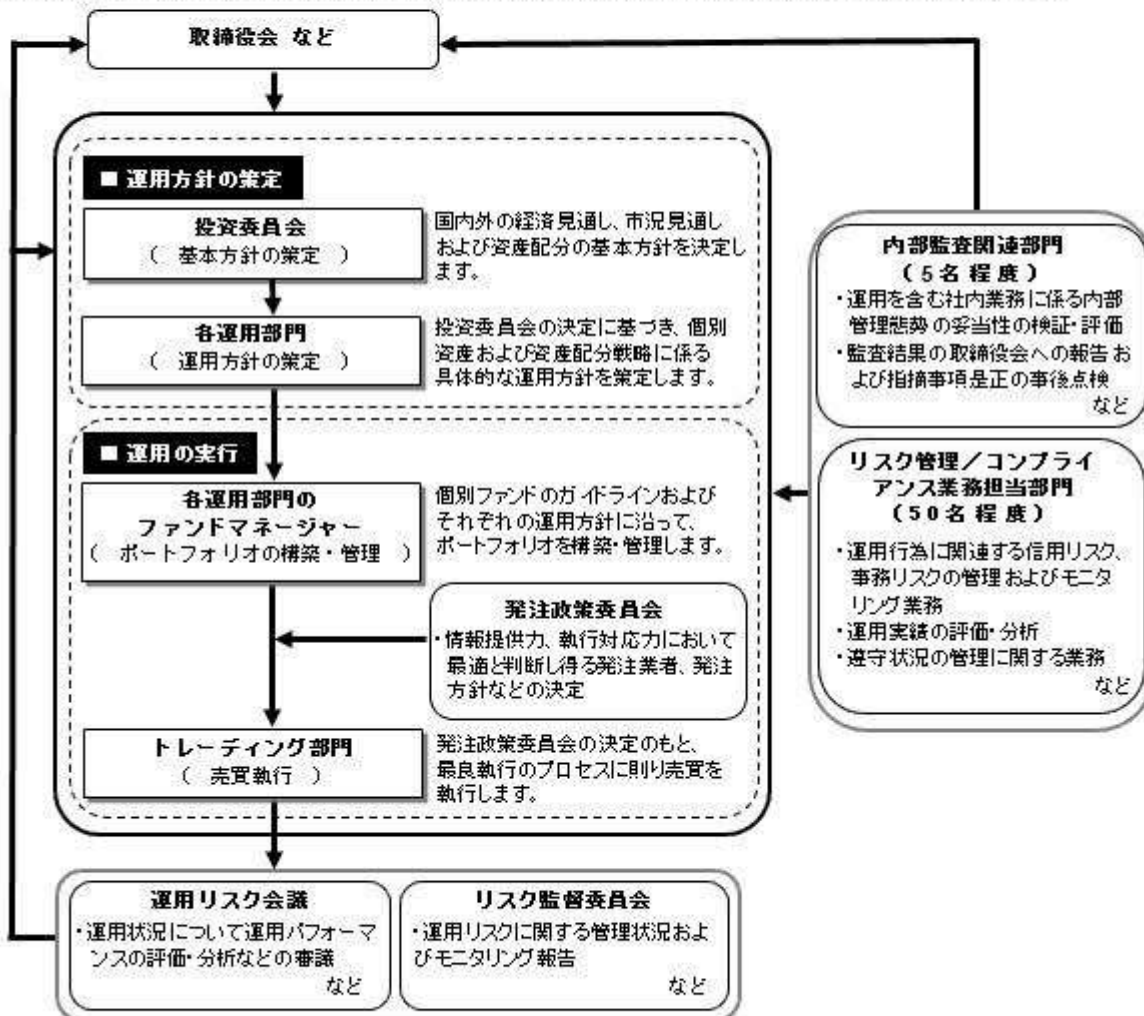
## (3) 【運用体制】

&lt;更新後&gt;

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



## 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

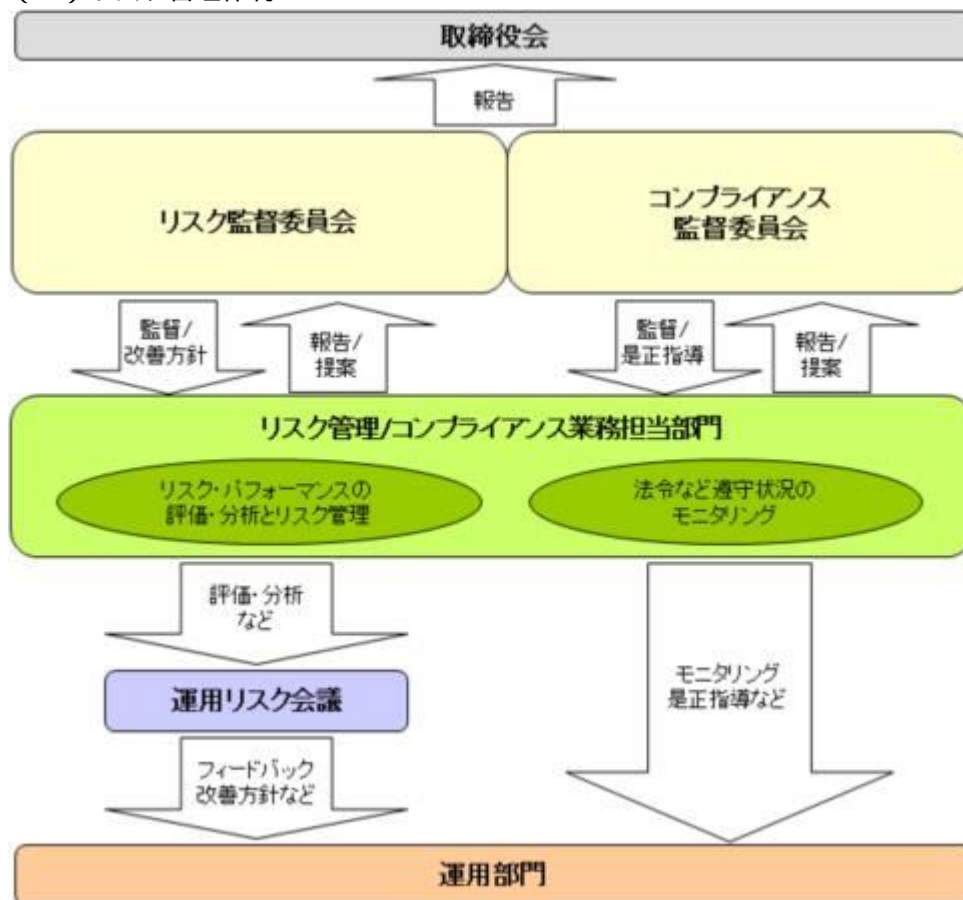
「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

上記体制は2020年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 3 【投資リスク】

&lt; 更新後 &gt;

## (2) リスク管理体制

**全社的リスク管理**

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

**運用状況の評価・分析および運用リスク管理**

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスクの管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスクの管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

**法令など遵守状況のモニタリング**

運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

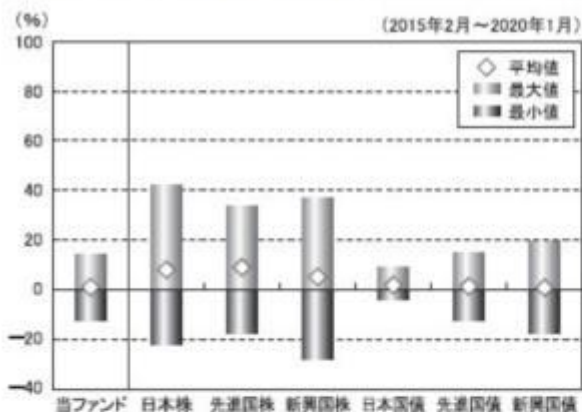
上記体制は2020年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

&lt; 更新後 &gt;



## （参考情報）

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



## （当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率 (%)）

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	1.2%	8.1%	9.1%	5.3%	2.0%	1.5%	0.9%
最大値	14.5%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	15.3%	19.3%
最小値	-11.9%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2015年2月から2020年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

日本株…… 東証株価指数（TOPIX、配当込）

先進国株…… MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

新興国株…… MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

日本国債…… NOMURA-BPI国債

先進国債…… FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債…… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

## 東証株価指数（TOPIX、配当込）

当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

## MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。

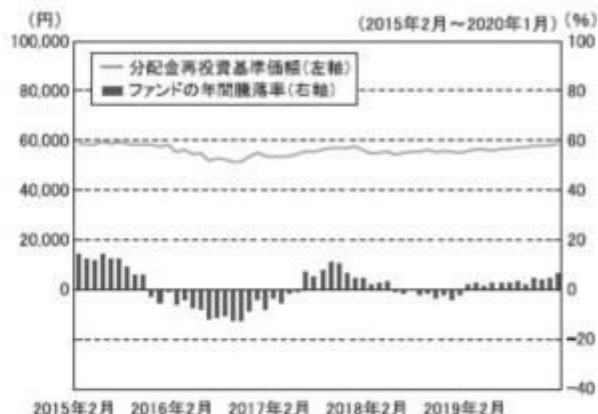
## MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。

## NOMURA-BPI国債

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2015年2月 2016年2月 2017年2月 2018年2月 2019年2月

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2015年2月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数は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。

## JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

### 4【手数料等及び税金】

#### （2）【換金（解約）手数料】

<訂正前>

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%<sup>\*</sup>の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

\* 2020年2月7日以降は、0.1%に変更予定です。

「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことで

<訂正後>

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことで

#### （5）【課税上の取扱い】

<更新後>

課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

個人受益者の場合

##### 1) 受益権の売却時の課税

売却時の差益（譲渡益）については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

##### 2) 収益分配金の受取り時の課税

収益分配金は配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

##### 3) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

確定申告等により、解約時、償還時および売却時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限りま

の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 受益権の売却時の課税

受益権の売却価額と取得価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

2) 収益分配金の受取り時の課税

収益分配金は配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれ、他の法人所得と合算して課税されます。

3) 解約金および償還金に対する課税

受益権の解約価額および償還価額と取得価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されません。

4) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2020年4月10日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【上場インデックスファンド海外債券（FTSE WGBI）毎月分配型】

以下の運用状況は2020年1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	27,145,367,332	100.00
親投資信託受益証券	日本	20,057	0.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		599,988	0.00
合計（純資産総額）		27,145,987,377	100.00

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	投資信託受益証券	海外債券インデックスファンド（適格機関投資家向け）	26,804,944,537	1.0004	26,816,790,107	1.0127	27,145,367,332	100.00

日本	親投資信託受益証券	マネー・オープン・マザーファンド	19,740	1.0162	20,059	1.0161	20,057	0.00
----	-----------	------------------	--------	--------	--------	--------	--------	------

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	100.00
親投資信託受益証券	0.00
合 計	100.00

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)		東京証券取引所 取引価格(円)
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き	
第1特定期間末 (2010年 2月10日)	1,452	1,458	48,419	48,623	48,850
第2特定期間末 (2010年 7月10日)	2,301	2,311	46,023	46,226	46,500
第3特定期間末 (2011年 1月10日)	2,982	2,996	42,604	42,807	43,550
第4特定期間末 (2011年 7月10日)	4,752	4,774	43,208	43,408	43,950
第5特定期間末 (2012年 1月10日)	4,649	4,666	38,747	38,887	39,000
第6特定期間末 (2012年 7月10日)	4,851	4,868	40,432	40,572	40,650
第7特定期間末 (2013年 1月10日)	5,536	5,552	46,136	46,274	46,000
第8特定期間末 (2013年 7月10日)	5,021	5,035	50,215	50,352	49,500
第9特定期間末 (2014年 1月10日)	5,106	5,119	53,189	53,325	53,300
第10特定期間末 (2014年 7月10日)	5,334	5,348	53,349	53,485	53,600
第11特定期間末 (2015年 1月10日)	6,709	6,725	59,907	60,046	60,200
第12特定期間末 (2015年 7月10日)	6,896	6,913	57,474	57,614	57,900
第13特定期間末 (2016年 1月10日)	6,870	6,887	54,962	55,102	55,700
第14特定期間末 (2016年 7月10日)	6,809	6,828	48,986	49,124	49,550
第15特定期間末 (2017年 1月10日)	7,355	7,374	51,796	51,932	52,100
第16特定期間末 (2017年 7月10日)	12,449	12,482	52,179	52,315	52,200
第17特定期間末 (2018年 1月10日)	15,236	15,275	52,323	52,459	52,400
第18特定期間末 (2018年 7月10日)	17,652	17,696	50,406	50,532	50,400
第19特定期間末 (2019年 1月10日)	20,098	20,147	48,267	48,385	48,300

第20特定期間末 (2019年 7月10日)	24,212	24,268	49,902	50,019	50,000
第21特定期間末 (2020年 1月10日)	25,964	26,024	50,009	50,124	50,100
2019年 1月末日	20,924		48,889		49,050
2月末日	22,225		49,456		49,450
3月末日	23,083		49,985		49,700
4月末日	23,517		49,721		49,800
5月末日	23,620		49,189		49,200
6月末日	24,107		49,686		49,550
7月末日	24,116		49,704		49,850
8月末日	24,803		49,886		49,700
9月末日	24,455		49,991		49,850
10月末日	24,979		50,342		50,100
11月末日	25,081		50,243		50,200
12月末日	26,132		50,333		50,100
2020年 1月末日	27,145		50,627		50,500

(注)特定期間末が東京証券取引所の休業日にあたる場合、東京証券取引所取引価格は直前営業日の終値を表示しています。

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2009年 9月25日～2010年 2月10日	204.0000
第2特定期間	2010年 2月11日～2010年 7月10日	1,017.0000
第3特定期間	2010年 7月11日～2011年 1月10日	1,221.0000
第4特定期間	2011年 1月11日～2011年 7月10日	1,214.0000
第5特定期間	2011年 7月11日～2012年 1月10日	1,020.0000
第6特定期間	2012年 1月11日～2012年 7月10日	840.0000
第7特定期間	2012年 7月11日～2013年 1月10日	838.0000
第8特定期間	2013年 1月11日～2013年 7月10日	823.0000
第9特定期間	2013年 7月11日～2014年 1月10日	819.0000
第10特定期間	2014年 1月11日～2014年 7月10日	817.0000
第11特定期間	2014年 7月11日～2015年 1月10日	821.0000
第12特定期間	2015年 1月11日～2015年 7月10日	839.0000
第13特定期間	2015年 7月11日～2016年 1月10日	838.0000
第14特定期間	2016年 1月11日～2016年 7月10日	843.0000
第15特定期間	2016年 7月11日～2017年 1月10日	818.0000
第16特定期間	2017年 1月11日～2017年 7月10日	809.0000
第17特定期間	2017年 7月11日～2018年 1月10日	819.0000
第18特定期間	2018年 1月11日～2018年 7月10日	791.0000
第19特定期間	2018年 7月11日～2019年 1月10日	719.0000
第20特定期間	2019年 1月11日～2019年 7月10日	710.0000
第21特定期間	2019年 7月11日～2020年 1月10日	685.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1特定期間	2009年 9月25日～2010年 2月10日	2.75
第2特定期間	2010年 2月11日～2010年 7月10日	2.85
第3特定期間	2010年 7月11日～2011年 1月10日	4.78
第4特定期間	2011年 1月11日～2011年 7月10日	4.27
第5特定期間	2011年 7月11日～2012年 1月10日	7.96
第6特定期間	2012年 1月11日～2012年 7月10日	6.52
第7特定期間	2012年 7月11日～2013年 1月10日	16.18
第8特定期間	2013年 1月11日～2013年 7月10日	10.63
第9特定期間	2013年 7月11日～2014年 1月10日	7.55
第10特定期間	2014年 1月11日～2014年 7月10日	1.84
第11特定期間	2014年 7月11日～2015年 1月10日	13.83
第12特定期間	2015年 1月11日～2015年 7月10日	2.66
第13特定期間	2015年 7月11日～2016年 1月10日	2.91
第14特定期間	2016年 1月11日～2016年 7月10日	9.34
第15特定期間	2016年 7月11日～2017年 1月10日	7.41
第16特定期間	2017年 1月11日～2017年 7月10日	2.30
第17特定期間	2017年 7月11日～2018年 1月10日	1.85
第18特定期間	2018年 1月11日～2018年 7月10日	2.15
第19特定期間	2018年 7月11日～2019年 1月10日	2.82
第20特定期間	2019年 1月11日～2019年 7月10日	4.86
第21特定期間	2019年 7月11日～2020年 1月10日	1.59

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1特定期間	2009年 9月25日～2010年 2月10日	30,000	0
第2特定期間	2010年 2月11日～2010年 7月10日	20,000	0
第3特定期間	2010年 7月11日～2011年 1月10日	20,000	0
第4特定期間	2011年 1月11日～2011年 7月10日	40,000	0
第5特定期間	2011年 7月11日～2012年 1月10日	10,000	0
第6特定期間	2012年 1月11日～2012年 7月10日	10,000	10,000
第7特定期間	2012年 7月11日～2013年 1月10日	0	0
第8特定期間	2013年 1月11日～2013年 7月10日	0	20,000
第9特定期間	2013年 7月11日～2014年 1月10日	3,000	7,000

第10特定期間	2014年 1月11日～2014年 7月10日	4,000	0
第11特定期間	2014年 7月11日～2015年 1月10日	12,000	0
第12特定期間	2015年 1月11日～2015年 7月10日	8,000	0
第13特定期間	2015年 7月11日～2016年 1月10日	7,000	2,000
第14特定期間	2016年 1月11日～2016年 7月10日	14,000	0
第15特定期間	2016年 7月11日～2017年 1月10日	7,000	4,000
第16特定期間	2017年 1月11日～2017年 7月10日	96,600	0
第17特定期間	2017年 7月11日～2018年 1月10日	52,600	0
第18特定期間	2018年 1月11日～2018年 7月10日	59,000	0
第19特定期間	2018年 7月11日～2019年 1月10日	69,200	3,000
第20特定期間	2019年 1月11日～2019年 7月10日	68,800	0
第21特定期間	2019年 7月11日～2020年 1月10日	46,000	12,000

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

海外債券インデックスファンド（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2020年 1月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	12,978,939,119	47.81
	カナダ	515,922,977	1.90
	メキシコ	238,427,163	0.88
	ドイツ	1,672,416,715	6.16
	イタリア	2,394,128,949	8.82
	フランス	2,619,489,571	9.65
	オランダ	489,178,787	1.80
	スペイン	1,481,802,020	5.46
	ベルギー	627,263,405	2.31
	オーストリア	371,020,680	1.37
	フィンランド	145,981,182	0.54
	アイルランド	186,888,793	0.69
	イギリス	1,782,327,930	6.57
	スウェーデン	74,135,765	0.27
	ノルウェー	60,882,565	0.22
	デンマーク	131,299,309	0.48
	ポーランド	153,461,930	0.57
	オーストラリア	517,410,951	1.91
シンガポール	112,935,181	0.42	

	マレーシア	128,309,151	0.47
	南アフリカ	156,719,665	0.58
	小計	26,838,941,808	98.87
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		306,108,803	1.13
合計（純資産総額）		27,145,050,611	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,010,000	11,386.11	684,305,764	11,462.80	688,914,368	2.750	2023/11/15	2.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,160,000	11,002.27	457,694,816	11,019.31	458,403,706	2.000	2021/11/15	1.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,910,000	10,931.77	427,432,326	10,983.74	429,464,537	1.625	2022/11/15	1.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,550,000	11,242.24	399,099,738	11,343.94	402,709,993	2.250	2024/11/15	1.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,390,000	11,287.71	382,653,369	11,384.41	385,931,652	2.375	2024/8/15	1.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,280,000	11,005.04	360,965,584	11,017.40	361,370,805	2.125	2021/8/15	1.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,130,000	10,986.09	343,864,629	11,084.07	346,931,523	1.750	2024/7/31	1.28
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,120,000	10,921.97	340,765,623	10,927.51	340,938,411	1.750	2020/12/31	1.26
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,070,000	10,990.77	337,416,844	11,025.07	338,469,668	1.875	2022/4/30	1.25
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,830,000	11,133.27	315,071,791	11,133.06	315,065,772	3.125	2021/5/15	1.16
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,770,000	11,264.27	312,020,513	11,335.20	313,985,316	2.500	2023/8/15	1.16
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,700,000	11,268.96	304,262,049	11,405.71	307,954,337	2.250	2025/11/15	1.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	12,634.13	290,585,037	13,199.24	303,582,559	3.000	2048/8/15	1.12
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,740,000	10,980.76	300,872,960	11,008.02	301,620,021	1.875	2022/1/31	1.11
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,280,000	12,026.84	274,212,104	12,565.33	286,489,534	2.750	2047/11/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,950,000	13,966.06	272,338,361	14,487.30	282,502,355	3.750	2043/11/15	1.04
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,435,000	10,897.05	265,343,257	11,365.88	276,759,253	2.250	2046/8/15	1.02
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	10,861.69	260,680,665	10,874.47	260,987,397	1.250	2021/3/31	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,280,000	11,118.36	253,498,793	11,248.72	256,471,013	2.000	2025/8/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,130,000	11,302.40	240,741,267	11,474.73	244,411,759	2.250	2027/2/15	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,980,000	11,424.24	226,200,104	11,885.19	235,326,886	2.500	2045/2/15	0.87
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,070,000	11,056.38	228,867,124	11,115.59	230,092,901	2.000	2023/2/15	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,020,000	11,189.08	226,019,558	11,309.43	228,450,604	2.125	2025/5/15	0.84
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,830,000	11,925.02	218,228,037	12,400.67	226,932,350	2.750	2042/11/15	0.84
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,105.58	222,111,749	11,132.42	222,648,542	2.375	2022/3/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	10,993.97	219,879,443	11,001.64	220,032,803	2.250	2021/3/31	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,980,000	10,867.01	215,166,986	11,025.49	218,304,841	1.625	2026/5/15	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,290,000	15,706.13	202,609,087	16,273.37	209,926,478	4.750	2041/2/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	12,650.96	194,824,784	13,240.13	203,898,143	3.000	2049/2/15	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,115.31	188,960,327	11,281.74	191,789,673	2.000	2026/11/15	0.71

## ロ. 種類別の投資比率



種類	投資比率(%)
国債証券	98.87
合 計	98.87

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### マネー・オープン・マザーファンド

以下の運用状況は2020年 1月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		749,519,055	100.00
合計(純資産総額)		749,519,055	100.00

#### 投資資産

##### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

##### ロ. 種類別の投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

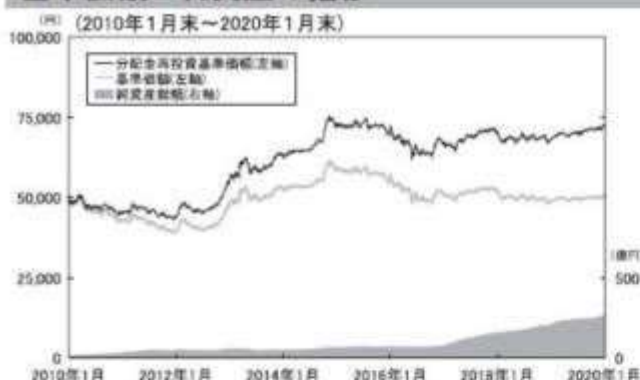
該当事項はありません。

#### 参考情報

## 運用実績

2020年1月31日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 50.627円

純資産総額…………… 271.45億円

※基準価額は、運用管理費用（信託報酬）控除後の1口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額は、2010年1月末の基準価額を起点として指数化しています。  
 ※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

## 分配の推移（税引前、1口当たり）

2019年9月	2019年10月	2019年11月	2019年12月	2020年1月	直近1年間累計	設定来累計
115円	113円	114円	115円	115円	1,395円	17,505円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
海外債券インデックスファンド（適格機関投資家向け）	100.00%
マネー・オープン・マザーファンド	0.00%
現金その他	0.00%

※対純資産総額比です。

## &lt;組入上位10銘柄&gt;

海外債券インデックスファンド（適格機関投資家向け）

銘柄	国・地域	種類	クーポン	償還期限	比率
1 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	2.750%	2023年11月15日	2.54%
2 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	2.000%	2021年11月15日	1.69%
3 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	1.625%	2022年11月15日	1.58%
4 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	2.250%	2024年11月15日	1.48%
5 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	2.375%	2024年8月15日	1.42%
6 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	2.125%	2021年8月15日	1.33%
7 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	1.750%	2024年7月31日	1.28%
8 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	1.750%	2020年12月31日	1.26%
9 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	1.875%	2022年4月30日	1.25%
10 US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	3.125%	2021年5月15日	1.16%

※海外債券インデックスファンド(適格機関投資家向け)の対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。  
 ※2020年は、2020年1月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
 ※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

&lt;訂正前&gt;

## (4) 取得申込不可日

取得申込日が次に該当する場合には、原則として取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- 1) ファンドの計算期間終了日（決算日）の3営業日前以降の2営業日間（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前以降の3営業日間）
- 2) 英国証券取引所の休業日、ニューヨーク証券取引所の休業日、ロンドンの銀行休業日またはニューヨークの銀行休業日
- 3) 1) および2) のほか、委託会社が約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

<訂正後>

## (4) 取得申込不可日

販売会社の営業日であっても、下記のいずれかに該当する場合は、原則として取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- 1) 取得申込日がファンドの計算期間終了日（決算日）の2営業日前となる場合（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、取得申込日が当該計算期間終了日の3営業日前以降の2営業日間となる場合）
- 2) 取得申込日が英国証券取引所の休業日、ニューヨーク証券取引所の休業日、ロンドンの銀行休業日またはニューヨークの銀行休業日の場合
- 3) 1) および2) のほか、委託会社が約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

## 2【換金（解約）手続等】

## &lt;解約請求による換金&gt;

<訂正前>

## (3) 解約請求不可日

解約請求日が次に該当する場合には、原則として解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- 1) ファンドの計算期間終了日（決算日）の6営業日前以降の5営業日間（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の7営業日前以降の6営業日間）
- 2) 英国証券取引所の休業日、ニューヨーク証券取引所の休業日、ロンドンの銀行休業日またはニューヨークの銀行休業日
- 3) 1) および2) のほか、委託会社が約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

<訂正後>

## (3) 解約請求不可日

販売会社の営業日であっても、下記のいずれかに該当する場合は、原則として解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- 1) 解約請求日がファンドの計算期間終了日（決算日）の6営業日前以降の5営業日間となる場合（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、解約請求日が当該計算期間終了日の7営業日前以降の6営業日間となる場合）
- 2) 解約請求日が英国証券取引所の休業日、ニューヨーク証券取引所の休業日、ロンドンの銀行休業日またはニューヨークの銀行休業日の場合
- 3) 1) および2) のほか、委託会社が約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

<訂正前>

## (5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額(当該基準価額に $0.2\%^{*}$ の率を乗じて得た額)を控除した価額とします。

\*2020年2月7日以降は、0.1%に変更予定です。

(略)

<訂正後>

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額(当該基準価額に $0.1\%$ の率を乗じて得た額)を控除した価額とします。

(略)

<買取請求による換金>

<訂正前>

(4) 受益権の買取価額は、買取請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額に相当する額(当該基準価額に $0.2\%^{*}$ の率を乗じて得た額)を控除した価額とします。

\*2020年2月7日以降は、0.1%に変更予定です。

<訂正後>

(4) 受益権の買取価額は、買取請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額に相当する額(当該基準価額に $0.1\%$ の率を乗じて得た額)を控除した価額とします。

## 第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2019年7月11日から2020年1月10日までの特定期間の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【上場インデックスファンド海外債券（FTSE WGBI）毎月分配型】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2019年 7月10日現在	当期 2020年 1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	28,478,812	-
コール・ローン	55,651,484	78,272,429
投資信託受益証券	24,208,456,736	25,960,183,181
親投資信託受益証券	20,063	20,059
流動資産合計	24,292,607,095	26,038,475,669
資産合計	24,292,607,095	26,038,475,669
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	56,768,400	59,708,000
未払受託者報酬	515,690	575,262
未払委託者報酬	2,686,294	3,038,576
未払利息	95	52
その他未払費用	20,426,124	10,506,922
流動負債合計	80,396,603	73,828,812
負債合計	80,396,603	73,828,812
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	24,260,000,000	25,960,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	47,789,508	4,646,857
（分配準備積立金）	384,136	373,481
元本等合計	24,212,210,492	25,964,646,857
純資産合計	24,212,210,492	25,964,646,857
負債純資産合計	24,292,607,095	26,038,475,669

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2019年 1月11日 至 2019年 7月10日	当期 自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	358,155,005	373,821,368
受取利息	41	-
有価証券売買等損益	718,803,023	58,917,020

	前期	当期
	自 2019年 1月11日 至 2019年 7月10日	自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日
営業収益合計	1,076,958,069	432,738,388
営業費用		
支払利息	13,582	13,523
受託者報酬	2,978,222	3,274,573
委託者報酬	15,342,143	17,159,903
その他費用	9,272,881	10,598,024
営業費用合計	27,606,828	31,046,023
営業利益又は営業損失( )	1,049,351,241	401,692,365
経常利益又は経常損失( )	1,049,351,241	401,692,365
当期純利益又は当期純損失( )	1,049,351,241	401,692,365
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	-	-
期首剰余金又は期首欠損金( )	721,531,149	47,789,508
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,763,200	3,444,000
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,444,000
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,763,200	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	46,898,800	9,914,000
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	46,898,800	9,914,000
分配金	330,474,000	342,786,000
期末剰余金又は期末欠損金( )	47,789,508	4,646,857

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	前期	当期
	2019年 7月10日現在	2020年 1月10日現在
1. 期首元本額	20,820,000,000円	24,260,000,000円
期中追加設定元本額	3,440,000,000円	2,300,000,000円
期中一部解約元本額	- 円	600,000,000円
2. 受益権の総数	485,200口	519,200口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	47,789,508円	- 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2019年 1月11日 至 2019年 7月10日		当期 自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2019年 1月11日 至 2019年 2月10日		自 2019年 7月11日 至 2019年 8月10日	
A 当期配当等収益額	57,366,360円	A 当期配当等収益額	60,633,656円
B 親ファンドの配当等収益額	0円	B 親ファンドの配当等収益額	0円
C 分配準備積立金	309,918円	C 分配準備積立金	384,136円
D 配当等収益額合計 (A+B+C)	57,676,278円	D 配当等収益額合計 (A+B+C)	61,017,792円
E 経費	4,931,125円	E 経費	5,046,215円
F 収益分配可能額 (D-E)	52,745,153円	F 収益分配可能額 (D-E)	55,971,577円
G 収益分配金額	52,085,200円	G 収益分配金額	55,505,600円
H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	659,953円	H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	465,977円
I 口数	441,400口	I 口数	491,200口
J 分配金額 (1口当たり)	118円	J 分配金額 (1口当たり)	113円
自 2019年 2月11日 至 2019年 3月10日		自 2019年 8月11日 至 2019年 9月10日	
A 当期配当等収益額	58,536,553円	A 当期配当等収益額	62,133,963円
B 親ファンドの配当等収益額	0円	B 親ファンドの配当等収益額	0円
C 分配準備積立金	659,953円	C 分配準備積立金	465,977円
D 配当等収益額合計 (A+B+C)	59,196,506円	D 配当等収益額合計 (A+B+C)	62,599,940円
E 経費	4,704,608円	E 経費	5,137,998円
F 収益分配可能額 (D-E)	54,491,898円	F 収益分配可能額 (D-E)	57,461,942円
G 収益分配金額	53,597,600円	G 収益分配金額	57,178,000円
H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	894,298円	H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	283,942円
I 口数	450,400口	I 口数	497,200口
J 分配金額 (1口当たり)	119円	J 分配金額 (1口当たり)	115円
自 2019年 3月11日 至 2019年 4月10日		自 2019年 9月11日 至 2019年10月10日	
A 当期配当等収益額	60,018,484円	A 当期配当等収益額	61,132,468円
B 親ファンドの配当等収益額	0円	B 親ファンドの配当等収益額	0円
C 分配準備積立金	894,298円	C 分配準備積立金	283,942円
D 配当等収益額合計 (A+B+C)	60,912,782円	D 配当等収益額合計 (A+B+C)	61,416,410円
E 経費	5,435,301円	E 経費	4,977,926円
F 収益分配可能額 (D-E)	55,477,481円	F 収益分配可能額 (D-E)	56,438,484円
G 収益分配金額	54,954,200円	G 収益分配金額	55,844,600円
H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	523,281円	H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	593,884円
I 口数	461,800口	I 口数	494,200口
J 分配金額 (1口当たり)	119円	J 分配金額 (1口当たり)	113円
自 2019年 4月11日 至 2019年 5月10日		自 2019年10月11日 至 2019年11月10日	
A 当期配当等収益額	61,473,424円	A 当期配当等収益額	62,011,668円
B 親ファンドの配当等収益額	0円	B 親ファンドの配当等収益額	0円
C 分配準備積立金	523,281円	C 分配準備積立金	593,884円

D 配当等収益額合計 (A+B+C)	61,996,705円	D 配当等収益額合計 (A+B+C)	62,605,552円
E 経費	5,383,978円	E 経費	5,277,446円
F 収益分配可能額 (D-E)	56,612,727円	F 収益分配可能額 (D-E)	57,328,106円
G 収益分配金額	56,287,000円	G 収益分配金額	56,566,800円
H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	325,727円	H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	761,306円
I 口数	473,000口	I 口数	496,200口
J 分配金額 (1口当たり) 自 2019年 5月11日 至 2019年 6月10日	119円	J 分配金額 (1口当たり) 自 2019年11月11日 至 2019年12月10日	114円
A 当期配当等収益額	62,539,146円	A 当期配当等収益額	63,010,989円
B 親ファンドの配当等収益額	0円	B 親ファンドの配当等収益額	0円
C 分配準備積立金	325,727円	C 分配準備積立金	761,306円
D 配当等収益額合計 (A+B+C)	62,864,873円	D 配当等収益額合計 (A+B+C)	63,772,295円
E 経費	3,919,183円	E 経費	5,119,710円
F 収益分配可能額 (D-E)	58,945,690円	F 収益分配可能額 (D-E)	58,652,585円
G 収益分配金額	56,781,600円	G 収益分配金額	57,983,000円
H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	2,164,090円	H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	669,585円
I 口数	481,200口	I 口数	504,200口
J 分配金額 (1口当たり) 自 2019年 6月11日 至 2019年 7月10日	118円	J 分配金額 (1口当たり) 自 2019年12月11日 至 2020年 1月10日	115円
A 当期配当等収益額	58,207,497円	A 当期配当等収益額	64,885,101円
B 親ファンドの配当等収益額	0円	B 親ファンドの配当等収益額	0円
C 分配準備積立金	2,164,090円	C 分配準備積立金	669,585円
D 配当等収益額合計 (A+B+C)	60,371,587円	D 配当等収益額合計 (A+B+C)	65,554,686円
E 経費	3,219,051円	E 経費	5,473,205円
F 収益分配可能額 (D-E)	57,152,536円	F 収益分配可能額 (D-E)	60,081,481円
G 収益分配金額	56,768,400円	G 収益分配金額	59,708,000円
H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	384,136円	H 次期繰越金 (分配準備積立金) (F-G)	373,481円
I 口数	485,200口	I 口数	519,200口
J 分配金額 (1口当たり)	117円	J 分配金額 (1口当たり)	115円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2019年 1月11日 至 2019年 7月10日	当期 自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左



金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	前期 2019年 7月10日現在	当期 2020年 1月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

前期(2019年 7月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	138,640,875
親投資信託受益証券	0
合計	138,640,875

当期(2020年 1月10日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	153,185,143
親投資信託受益証券	0
合計	153,185,143

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前期 2019年 7月10日現在	当期 2020年 1月10日現在
1口当たり純資産額 49,902円	1口当たり純資産額 50,009円

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	海外債券インデックスファンド(適格機関投資家向け)	25,954,992,183	25,960,183,181	

投資信託受益証券 合計		25,954,992,183	25,960,183,181	
親投資信託受益証券	マネー・オープン・マザーファンド	19,740	20,059	
親投資信託受益証券 合計		19,740	20,059	
	合計	25,955,011,923	25,960,203,240	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「海外債券インデックスファンド（適格機関投資家向け）」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は同投資信託です。なお、同投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

また、当ファンドは、「マネー・オープン・マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

### 海外債券インデックスファンド（適格機関投資家向け）

#### 貸借対照表

（単位：円）

	2019年 7月10日現在	2020年 1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	18,869,076	33,150,008
金銭信託	2,524,735	-
コール・ローン	4,933,677	4,541,809
国債証券	23,996,615,695	25,806,990,462
派生商品評価勘定	-	3,460
未収利息	174,131,146	196,671,259
前払費用	12,077,902	13,726,138
その他未収収益	631,438	1,745,575
流動資産合計	24,209,783,669	26,056,828,711
資産合計	24,209,783,669	26,056,828,711
<b>負債の部</b>		
流動負債		

	2019年 7月10日現在	2020年 1月10日現在
派生商品評価勘定	-	11,505
未払金	-	96,960,936
未払受託者報酬	34,549	74,292
未払委託者報酬	108,609	236,905
未払利息	8	3
その他未払費用	4,107	124,706
流動負債合計	147,273	97,408,347
負債合計	147,273	97,408,347
純資産の部		
元本等		
元本	24,254,540,363	25,954,992,183
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	44,903,967	4,428,181
(分配準備積立金)	1,269,100,638	1,151,770,582
元本等合計	24,209,636,396	25,959,420,364
純資産合計	24,209,636,396	25,959,420,364
負債純資産合計	24,209,783,669	26,056,828,711

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 7月10日現在	2020年 1月10日現在
1. 期首	2019年 1月11日	2019年 7月11日
期首元本額	20,814,899,516円	24,254,540,363円
期首からの追加設定元本額	3,439,640,847円	2,300,379,495円

	期首からの一部解約元本額	- 円	599,927,675円
2.	受益権の総数	24,254,540,363口	25,954,992,183口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	44,903,967円	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 1月11日 至 2019年 7月10日	自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月10日現在	2020年 1月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品

	短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2019年 7月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	18,483,388
合計	18,483,388

（2020年 1月10日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	128,447,542
合計	128,447,542

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

（2019年 7月10日現在）

該当事項はありません。

（2020年 1月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	98,019,878	-	98,011,833	8,045
	米ドル	42,720,600	-	42,720,600	-
	加ドル	4,108,160	-	4,108,160	-
	ユーロ	36,017,280	-	36,020,240	2,960
	英ポンド	7,159,000	-	7,159,500	500
	ノルウェークローネ	2,695,929	-	2,695,056	873
	マレーシアリンギット	2,830,840	-	2,824,407	6,433
	南アフリカランド	2,488,069	-	2,483,870	4,199
合計	98,019,878	-	98,011,833	8,045	

## (注) 1. 時価の算定方法

(1)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2019年 7月10日現在		2020年 1月10日現在	
1口当たり純資産額	0.9981円	1口当たり純資産額	1.0002円
(1万口当たり純資産額)	(9,981円)	(1万口当たり純資産額)	(10,002円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	3,120,000.00	3,124,204.51	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	1,360,000.00	1,389,537.43	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	2,000,000.00	2,015,351.40	
		US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	2,400,000.00	2,389,500.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	2,830,000.00	2,886,655.18	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	1,100,000.00	1,092,351.56	
		US TREASURY N/B-1.75%-21/07/31	1,390,000.00	1,392,904.82	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,280,000.00	3,306,841.88	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,160,000.00	4,191,687.13	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/01/31	2,740,000.00	2,755,626.49	
		US TREASURY N/B-2.375%-22/03/15	2,000,000.00	2,034,296.80	
		US TREASURY N/B-2.25%-22/04/15	1,000,000.00	1,014,707.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,070,000.00	3,090,266.60	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	800,000.00	803,156.24	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	1,250,000.00	1,255,151.25	
		US TREASURY N/B-1.5%-22/08/15	180,000.00	179,630.85	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	1,450,000.00	1,461,469.64	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	3,910,000.00	3,913,665.62	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	2,070,000.00	2,095,066.25	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	1,450,000.00	1,503,128.87	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	400,000.00	413,664.04	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	2,770,000.00	2,854,560.62	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	6,010,000.00	6,259,790.62	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	1,080,000.00	1,127,397.63	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	900,000.00	917,578.08	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	1,250,000.00	1,294,799.75	
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	3,130,000.00	3,143,571.36			



US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	3,390,000.00	3,498,320.99	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,120,000.00	3,205,495.17	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	985,000.00	1,000,679.13	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	2,020,000.00	2,065,015.90	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	2,280,000.00	2,316,292.80	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	2,700,000.00	2,779,998.03	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	600,000.00	596,261.71	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	1,980,000.00	1,965,884.75	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	1,480,000.00	1,491,446.76	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	1,650,000.00	1,623,510.47	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	1,600,000.00	1,624,281.11	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,130,000.00	2,197,976.82	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	750,000.00	774,770.47	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	710,000.00	936,853.30	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	850,000.00	878,222.63	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	1,000,000.00	1,071,113.20	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	650,000.00	703,206.01	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,060,000.00	1,148,174.51	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	885,000.00	1,132,436.97	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	1,390,000.00	1,481,055.84	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	1,470,000.00	1,536,523.23	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	380,000.00	376,370.70	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	350,000.00	472,759.73	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	185,000.00	247,072.55	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	340,000.00	463,396.06	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	380,000.00	504,902.73	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	890,000.00	1,242,001.94	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,290,000.00	1,836,763.40	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	1,830,000.00	1,972,825.63	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	1,950,000.00	2,462,446.15	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	320,000.00	382,412.48	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	1,980,000.00	2,041,294.86	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,435,000.00	2,393,291.10	
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,280,000.00	2,476,070.88	
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	2,300,000.00	2,622,628.82	

		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	1,540,000.00	1,758,938.56	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	460,000.00	452,030.84	
米ドル小計			108,710,000.00	113,639,287.85	(12,451,456,769)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	245,000.00	242,373.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	683,000.00	697,534.24	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	240,000.00	236,515.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	250,000.00	244,085.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	447,000.00	458,604.12	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	619,000.00	616,616.85	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	140,000.00	143,703.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	212,000.00	220,075.08	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	308,000.00	318,376.52	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	225,000.00	223,600.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	291,000.00	419,083.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	205,000.00	211,219.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	366,000.00	496,189.86	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	103,000.00	99,428.99	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	116,000.00	172,821.44	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	159,000.00	237,476.04	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	201,000.00	282,262.29	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	183,000.00	250,428.18	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	169,000.00	208,562.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	100,000.00	107,224.00	
CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	59,000.00	78,423.98			
加ドル小計			5,321,000.00	5,964,605.14	(500,251,433)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	3,270,000.00	3,257,899.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	2,400,000.00	2,419,891.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	3,350,000.00	3,329,696.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	650,000.00	648,814.49	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	3,130,000.00	3,255,837.58	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	1,760,000.00	1,844,419.27	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	3,070,000.00	3,481,950.55	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	2,500,000.00	2,369,434.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	3,880,000.00	4,030,135.43	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	3,130,000.00	3,484,082.81	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,390,000.00	2,547,616.91	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	1,050,000.00	1,125,573.48	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	1,400,000.00	1,809,777.69	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	1,910,000.00	2,187,201.83	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	2,170,000.00	2,318,687.85	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	1,320,000.00	1,455,186.94	
		メキシコペソ小計	37,380,000.00	39,566,205.98 (230,275,318)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	257,000.00	283,298.81	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	263,000.00	298,367.71	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	172,000.00	179,028.26	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	84,000.00	89,053.02	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	472,000.00	509,204.64	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	260,000.00	277,938.18	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	579,000.00	845,554.80	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	110,000.00	118,915.28	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	310,000.00	452,316.34	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	124,000.00	170,477.44	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	542,000.00	909,482.04	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	247,000.00	422,035.06	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	159,000.00	189,712.44	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	27,000.00	32,742.08	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	118,000.00	163,932.31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	283,000.00	304,797.22	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	526,000.00	593,531.03	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	457,000.00	536,268.47	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	513,000.00	602,287.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	105,000.00	126,039.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	295,000.00	344,644.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	285,000.00	323,666.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	553,000.00	694,085.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	295,000.00	330,669.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	550,000.00	613,613.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	458,000.00	629,795.34	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	662,000.00	723,883.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	150,000.00	163,802.83	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	717,000.00	781,128.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	270,000.00	294,185.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	190,000.00	268,786.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	595,000.00	893,147.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	230,000.00	251,700.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	65,000.00	65,950.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	323,000.00	370,791.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	394,000.00	638,766.59	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	100,000.00	120,938.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	257,000.00	391,727.11	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	369,000.00	632,177.81	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	80,000.00	135,304.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	232,000.00	428,007.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	126,000.00	171,595.49	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	203,000.00	268,796.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	87,000.00	137,864.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	270,000.00	285,864.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	110,000.00	117,184.54	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	780,000.00	994,270.99	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	335,000.00	364,928.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	335,000.00	358,654.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	790,000.00	830,542.01	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	615,000.00	666,203.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	980,000.00	1,037,069.61	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	620,000.00	636,973.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	587,000.00	613,917.47	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	216,000.00	328,384.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	561,000.00	598,231.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	275,000.00	407,717.47	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	363,000.00	387,837.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	260,000.00	372,886.28	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	685,000.00	717,822.46
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	210,000.00	219,906.59
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	367,000.00	607,691.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	265,000.00	432,414.86
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	277,000.00	470,832.68
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	248,000.00	414,221.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	175,000.00	315,182.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	244,000.00	472,929.34
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	200,000.00	335,800.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	287,000.00	442,754.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	305,000.00	480,449.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	220,000.00	277,820.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	120,000.00	108,752.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	539,000.00	563,562.23
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	70,000.00	73,609.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	1,185,000.00	1,278,964.57
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	860,000.00	951,886.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,048,000.00	1,085,130.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	410,000.00	418,992.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,040,000.00	1,202,879.59
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	567,000.00	660,403.04

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	515,000.00	589,461.27	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	215,000.00	234,329.57	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	600,000.00	731,004.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	475,000.00	494,373.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	160,000.00	171,080.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	450,000.00	548,707.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	410,000.00	440,574.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	720,000.00	735,861.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	317,000.00	339,858.23	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	505,000.00	709,141.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	240,000.00	256,853.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	295,000.00	381,385.23	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	295,000.00	334,698.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	205,000.00	236,703.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	633,000.00	861,005.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	239,000.00	287,195.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	520,000.00	764,410.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	145,000.00	146,906.17	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	507,000.00	748,940.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	392,000.00	552,490.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	598,000.00	772,012.02	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	130,000.00	189,752.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	445,000.00	649,975.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	120,000.00	174,460.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	260,000.00	308,060.22	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	259,000.00	279,725.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	197,000.00	240,814.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	87,000.00	112,932.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	255,000.00	267,006.42	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	88,000.00	92,561.04	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	110,000.00	117,325.67	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	53,000.00	53,950.87	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	50,000.00	55,247.65	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	133,000.00	165,090.90	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	108,000.00	113,092.95	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	100,000.00	104,895.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	113,000.00	140,264.64	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	18,000.00	18,885.56	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	64,000.00	68,673.72	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	134,000.00	150,273.21	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	39,000.00	57,571.83	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	30,000.00	36,517.44	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	475,000.00	501,683.12	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	670,000.00	722,863.00	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	160,000.00	208,036.64	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	330,000.00	355,493.82	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	460,000.00	543,524.50	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	818,000.00	914,950.99	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	453,000.00	500,498.40	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	465,000.00	486,152.85	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	690,000.00	943,189.98	



FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	625,000.00	672,392.12	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	683,000.00	845,575.17	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	670,000.00	701,603.90	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	720,000.00	741,973.82	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	976,000.00	1,059,082.97	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	798,000.00	978,743.08	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	975,000.00	1,042,275.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	665,000.00	710,974.30	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	610,000.00	923,799.25	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	220,000.00	229,941.36	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	485,000.00	606,308.53	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	655,000.00	754,682.59	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	628,000.00	1,068,715.95	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	415,000.00	468,074.84	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	472,000.00	780,400.08	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	390,000.00	438,878.70	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	375,000.00	609,621.75	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	280,000.00	341,495.28	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	563,000.00	1,000,572.60	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	330,000.00	521,415.84	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	361,000.00	468,487.75	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	115,000.00	133,881.07	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	253,000.00	507,915.21	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	90,000.00	102,584.93	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	119,000.00	138,041.04	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	139,000.00	180,066.02	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	219,000.00	235,575.19	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	120,000.00	129,142.08	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	45,000.00	49,301.86	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	177,000.00	217,853.72	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	112,000.00	125,957.44	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	70,000.00	78,463.56	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	86,000.00	102,287.97	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	49,000.00	62,970.58	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	48,000.00	55,599.16	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	110,000.00	116,431.89	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	155,000.00	175,382.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	158,000.00	175,702.79	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	503,000.00	520,911.83	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	394,000.00	415,532.49	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	520,000.00	559,195.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	237,000.00	346,394.46	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	295,000.00	318,678.76	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	150,000.00	155,082.75	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	112,000.00	147,765.01	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	145,000.00	238,476.86	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	170,000.00	177,317.82	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	220,000.00	385,365.15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	109,000.00	177,714.35	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	34,000.00	43,221.61	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	40,000.00	64,962.88	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	117,000.00	130,342.56	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	105,000.00	106,844.43	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	114,000.00	123,695.81	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	114,000.00	125,156.04	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	148,000.00	160,888.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	155,000.00	204,427.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	177,000.00	188,728.02	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	186,000.00	195,126.09	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	130,000.00	193,103.17	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	262,000.00	280,032.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	105,000.00	109,948.44	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	153,000.00	199,224.66	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	229,000.00	374,983.14	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	130,000.00	209,341.08	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	124,000.00	152,312.14	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	28,000.00	58,931.83	
			64,430,000.00	79,139,028.44	
				(9,630,428,370)	
ユーロ小計					
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.5%-21/01/22	282,000.00	284,504.94	

		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	188,000.00	207,513.32	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	140,000.00	147,308.82	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	165,000.00	177,187.23	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	282,000.00	290,895.52	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	220,000.00	233,288.08	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	190,000.00	193,121.58	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	247,000.00	271,293.14	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	168,000.00	205,296.00	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	170,000.00	169,818.10	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	128,000.00	135,127.04	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	165,000.00	171,929.34	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	142,000.00	181,072.77	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	352,000.00	511,811.37	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	110,000.00	110,611.07	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	171,000.00	240,522.10	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	405,000.00	560,614.77	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	500,000.00	730,480.40	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	375,000.00	601,068.59	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	510,000.00	790,314.56	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	543,000.00	760,849.42	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	718,000.00	1,198,543.18	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	356,000.00	617,538.24	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	186,000.00	309,912.26	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	410,000.00	769,657.33	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	246,000.00	464,700.39	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	394,000.00	727,520.43	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	281,000.00	280,675.72	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	260,000.00	261,457.56	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	115,000.00	124,054.41	
		英債券小計	8,419,000.00	11,728,687.68 (1,679,665,362)	
スウェーデン ローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	620,000.00	676,563.22	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	820,000.00	874,626.59	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	1,800,000.00	2,055,205.80	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,080,000.00	1,157,036.40	

		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	400,000.00	423,502.64	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	120,000.00	126,981.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	760,000.00	1,170,565.98	
スウェーデンクローナ小計			5,600,000.00	6,484,481.63	(74,895,762)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	990,000.00	1,022,036.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	890,000.00	908,859.10	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	810,000.00	863,743.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	490,000.00	499,251.58	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	540,000.00	544,517.64	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	490,000.00	502,029.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	410,000.00	429,033.84	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	330,000.00	339,555.15	
ノルウェークローネ小計			4,950,000.00	5,109,026.71	(63,096,479)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	240,000.00	256,257.60	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	460,000.00	496,662.92	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	1,970,000.00	2,226,525.52	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,270,000.00	2,421,878.89	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	200,000.00	213,858.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	1,185,000.00	2,220,437.35	
デンマーククローネ小計			6,325,000.00	7,835,620.28	(127,563,898)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-21/05/25	200,000.00	196,233.27	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	590,000.00	592,362.95	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	255,000.00	273,807.52	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	236,000.00	239,293.38	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	520,000.00	575,356.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	300,000.00	306,780.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	382,000.00	412,770.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	510,000.00	522,852.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	100,000.00	101,405.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	500,000.00	530,750.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	397,000.00	405,614.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	371,000.00	378,327.25	

		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	205,000.00	212,719.27	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	353,000.00	461,019.58	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	100,000.00	104,175.00	
ポーランドズロチ小計			5,019,000.00	5,313,466.82	(152,283,959)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	340,000.00	362,346.36	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	385,000.00	432,378.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	389,000.00	447,851.07	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	666,000.00	745,504.53	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	480,000.00	574,564.46	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	735,000.00	923,116.26	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	367,000.00	411,415.29	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	323,000.00	350,671.79	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	414,000.00	467,755.41	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	112,000.00	131,844.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	481,000.00	548,374.63	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	353,000.00	395,581.99	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	200,000.00	276,371.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	61,000.00	71,696.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	178,000.00	236,680.63	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	70,000.00	88,238.98	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	79,000.00	92,901.30	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	127,000.00	157,742.25			
豪ドル小計			5,760,000.00	6,715,036.56	(504,769,298)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	55,000.00	55,594.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	22,000.00	21,920.58	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	86,000.00	86,498.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	60,000.00	62,550.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	153,000.00	159,395.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	127,000.00	135,241.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	72,000.00	75,024.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	75,000.00	77,385.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	128,000.00	143,936.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	113,000.00	121,079.50	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	45,000.00	49,433.62	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	101,000.00	111,675.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	75,000.00	88,780.87	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	89,000.00	100,792.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	61,000.00	69,175.22	
シンガポールドル小計			1,262,000.00	1,358,482.85 (110,172,959)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	205,000.00	207,265.25	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	120,000.00	122,718.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	100,000.00	103,329.67	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	260,000.00	270,140.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	365,000.00	417,742.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	110,000.00	128,270.42	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	135,000.00	157,808.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	210,000.00	213,559.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	175,000.00	176,634.88	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	220,000.00	222,632.12	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	320,000.00	333,360.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	380,000.00	405,030.18	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	385,000.00	390,804.68	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	375,000.00	386,718.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	200,000.00	229,075.68	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	345,000.00	377,490.27			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	485,000.00	501,642.43			
マレーシアアリンギット小計			4,390,000.00	4,644,222.53 (124,465,163)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	590,000.00	589,956.25	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	1,370,000.00	1,391,474.26	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	3,340,000.00	3,734,079.75	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	2,100,000.00	1,958,969.56	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	1,780,000.00	1,506,037.35	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	1,600,000.00	1,467,545.35	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	1,350,000.00	1,258,161.39	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	1,020,000.00	728,947.28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	1,670,000.00	1,475,546.27	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	1,200,000.00	1,092,149.81	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	1,920,000.00	1,333,006.46	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	1,710,000.00	1,496,605.75	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	2,800,000.00	2,443,584.50	
南アフリカランド小計		22,450,000.00	20,476,063.98 (157,665,692)	
合計			25,806,990,462 (25,806,990,462)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 64銘柄	100.0%	48.3%
加ドル	国債証券 21銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 198銘柄	100.0%	37.3%
英ポンド	国債証券 30銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 18銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 17銘柄	100.0%	0.5%

南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	0.6%
----------	------	------	--------	------

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## マネー・オープン・マザーファンド

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	2019年 7月10日現在	2020年 1月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	92,313,011	-
コール・ローン	180,392,219	691,141,683
流動資産合計	272,705,230	691,141,683
資産合計	272,705,230	691,141,683
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,864	446,060
未払利息	308	467
流動負債合計	2,172	446,527
負債合計	2,172	446,527
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	268,314,924	679,715,517
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,388,134	10,979,639
元本等合計	272,703,058	690,695,156
純資産合計	272,703,058	690,695,156
負債純資産合計	272,705,230	691,141,683

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）



		2019年 7月10日現在	2020年 1月10日現在
1.	期首	2019年 1月11日	2019年 7月11日
	期首元本額	130,203,912円	268,314,924円
	期首からの追加設定元本額	146,164,020円	423,811,948円
	期首からの一部解約元本額	8,053,008円	12,411,355円
	元本の内訳		
	上場インデックスファンド中国A株(パンダ) E F u n d C S I 3 0 0	198,295円	198,295円
	上場インデックスファンド海外債券( F T S E W G B I ) 毎月分配型	19,740円	19,740円
	高金利先進国債券オープン(毎月分配型)	12,974,444円	11,273,987円
	世界銀行債券ファンド(毎月分配型)	14,779,706円	14,068,100円
	高金利先進国債券オープン(資産成長型)	979,108円	904,960円
	資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース	13,530,936円	11,348,528円
	資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース	3,726,563円	3,179,120円
	資源ファンド(株式と通貨)オーストラリアドル・コース	1,412,982円	1,322,533円
	資源ファンド(株式と通貨)円コース	27,258円	25,577円
	資源ファンド(株式と通貨)メキシコペソ・コース	31,170円	28,347円
	資源ファンド(株式と通貨)トルコリラ・コース	89,792円	56,724円
	資源ファンド(株式と通貨)米ドル・コース	155,554円	109,481円
	資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース (資産成長型)	17,150円	15,720円
	資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース (資産成長型)	11,472円	12,168円
	資源ファンド(株式と通貨)米ドル・コース(資産成長 型)	46,020円	44,659円
	グローバル3倍3分法ファンド(1年決算型)	94,209,389円	363,510,949円
	グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型)	45,580,461円	196,085,649円
	日興・G S 世界ソブリン・ファンド(毎月分配型)	8,837,950円	8,285,830円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(米ドルコース)	18,811,212円	18,750,257円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(円ヘッジコース)	5,045,630円	4,779,511円
	日興・アッシュモア・グローイング・マルチストラテ ジー・ファンド	3,341,384円	3,071,749円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド資産成 長型(米ドルコース)	1,229,491円	1,511,720円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(ブラジルリアルコース)	4,908,262円	4,689,916円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(南アフリカランドコース)	920,119円	889,590円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(トルコリラコース)	34,336,561円	32,470,194円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(メキシコペソコース)	1,038,985円	986,660円
	日興・世界ソブリン・ファンド V A (適格機関投資家 転売制限付)	691,096円	611,346円

日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（インドネシアルピアコース）	182,327円	286,950円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（インドルビーコース）	1,181,867円	1,177,257円
計	268,314,924円	679,715,517円
2. 受益権の総数	268,314,924口	679,715,517口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 1月11日 至 2019年 7月10日	自 2019年 7月11日 至 2020年 1月10日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月10日現在	2020年 1月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 該当事項はありません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

	短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2019年 7月10日現在		2020年 1月10日現在	
1口当たり純資産額	1.0164円	1口当たり純資産額	1.0162円
(1万口当たり純資産額)	(10,164円)	(1万口当たり純資産額)	(10,162円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 1月31日現在です。

## 【上場インデックスファンド海外債券（FTSE WGBI）毎月分配型】

## 【純資産額計算書】

資産総額	27,220,005,224円
負債総額	74,017,847円
純資産総額（ - ）	27,145,987,377円
発行済口数	536,200口
1口当たり純資産額（ / ）	50,627円

（参考）

海外債券インデックスファンド（適格機関投資家向け）

## 純資産額計算書

資産総額	27,147,216,848円
負債総額	2,166,237円
純資産総額（ - ）	27,145,050,611円
発行済口数	26,804,944,537口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0127円

マネー・オープン・マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	749,637,030円
負債総額	117,975円
純資産総額（ - ）	749,519,055円
発行済口数	737,611,173口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0161円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

<更新後>

##### (1) 資本金の額

2020年1月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の意思決定機関（2020年1月末現在）

###### ・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

###### ・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

##### (3) 運用の意思決定プロセス（2020年1月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

### 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2020年1月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	829	206,323
株式投資信託	781	175,242
単位型	264	10,935
追加型	517	164,306
公社債投資信託	48	31,081
単位型	35	930
追加型	13	30,150

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

#### (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<更新後>

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
シティグループ証券株式会社	96,307百万円	
野村證券株式会社	10,000百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
メリルリンチ日本証券株式会社	83,140百万円	

## 独立監査人の監査報告書

2020年2月5日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている上場インデックスファンド海外債券（FTSE WGBI）毎月分配型の2019年7月11日から2020年1月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、上場インデックスファンド海外債券（FTSE WGBI）毎月分配型の2020年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注)1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。