

運用報告書 (全体版)

第14期<決算日2022年10月12日>

DIAM外国債券パッシブ・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券 (インデックス型)
信託期間	2009年1月30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、円ベース、為替ヘッジなし) の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	DIAM外国債券パッシブ・ファンド
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
運用方法	原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。マザーファンドにおいては、外国債券への投資は原則として高位を維持します。
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
分配方針	決算日 (原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の利子配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から、基準価額水準、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は分配を行わない場合があります。

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM外国債券パッシブ・ファンド」は、2022年10月12日に第14期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

DIAM外国債券パッシブ・ファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配 金	期中 騰落 率	期中 騰落 率	期中 騰落 率			
10期 (2018年10月12日)	円 15,406	円 0	% △3.2	ポイント 112,209.80	% △2.7	% 97.4	% -	百万円 14,065
11期 (2019年10月15日)	16,056	0	4.2	117,767.24	5.0	97.8	-	16,436
12期 (2020年10月12日)	16,904	0	5.3	124,690.29	5.9	98.8	-	14,201
13期 (2021年10月12日)	17,414	0	3.0	129,083.69	3.5	99.0	-	16,054
14期 (2022年10月12日)	17,440	0	0.1	129,646.62	0.4	98.7	-	16,448

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています (以下同じ)。

(注4) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します (以下同じ)。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 比率
	円	騰 落 率	ポイ ント	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 10 月 12 日	17,414	% —	ポイ ント 129,083.69	% —	% 99.0	% —
10 月 末	17,661	1.4	130,788.36	1.3	98.8	—
11 月 末	17,460	0.3	129,217.14	0.1	98.6	—
12 月 末	17,563	0.9	130,157.13	0.8	99.3	—
2022 年 1 月 末	17,257	△0.9	128,015.91	△0.8	99.0	—
2 月 末	16,943	△2.7	125,907.80	△2.5	98.8	—
3 月 末	17,496	0.5	129,775.21	0.5	98.3	—
4 月 末	17,530	0.7	129,955.37	0.7	99.0	—
5 月 末	17,420	0.0	129,451.47	0.3	98.7	—
6 月 末	17,827	2.4	132,579.22	2.7	99.0	—
7 月 末	17,945	3.0	133,117.57	3.1	98.9	—
8 月 末	17,727	1.8	131,430.25	1.8	98.7	—
9 月 末	17,566	0.9	130,076.63	0.8	99.0	—
(期 末) 2022 年 10 月 12 日	17,440	0.1	129,646.62	0.4	98.7	—

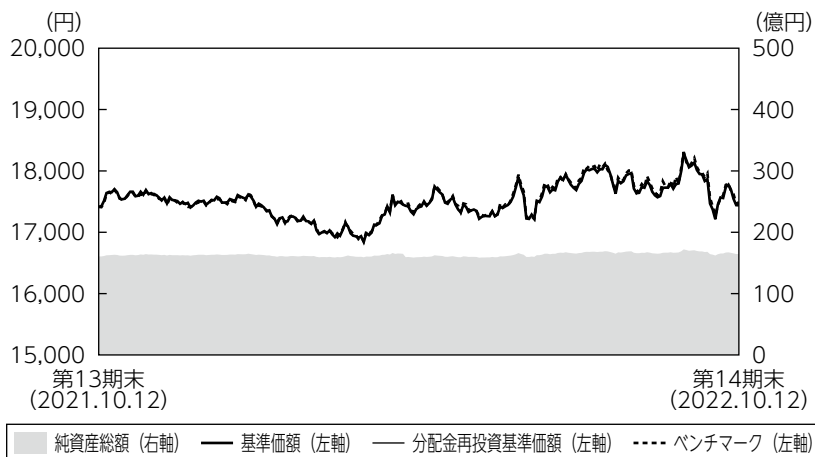
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年10月13日から2022年10月12日まで）

基準価額等の推移



第14期首：17,414円
第14期末：17,440円
(既払分配金0円)
騰落率：0.1%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

インフレ抑制のため各国中央銀行の積極的な利上げにより、米国債、ドイツ国債の利回りは上昇（価格は下落）しました。為替市場において米ドル円は、米国をはじめ各国中央銀行が積極的な金融引き締めを進める中、日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示すなど、金融政策の方向性の違いが意識されて米ドル高円安になりました。債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことを要因に基準価額は上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、米国債やドイツ国債の利回りは上昇する展開となりました。米国債は、堅調な米雇用統計や、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを積極的に続けるとの見方、米インフレ率の上振れなどを背景に利回りは上昇しました。ドイツ国債についてもロシアのウクライナ侵攻によるエネルギー価格の高騰や米国長期金利の上昇、E C B（欧州中央銀行）が大幅利上げを行ったことなどを受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。F R Bが金融引き締めペースを加速するとの見方などから米長期金利が上昇したことや、米国をはじめ各国中央銀行が金融政策の積極的な引き締めを進める中、日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示すなど、金融政策の方向性の違いが意識されたことなどが主な米ドル高円安の要因となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

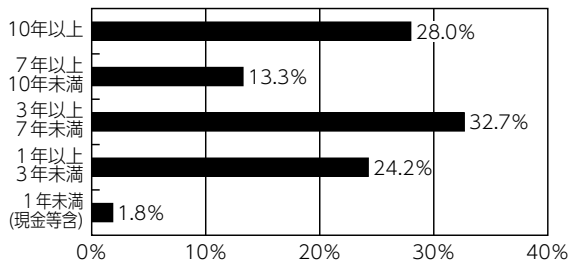
●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

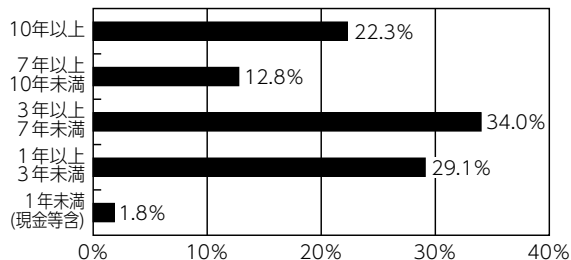
【運用状況】 ※比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)



期末



○国別構成比

期首 (前期末)

	ファンド	世界国債 インデックス	差	
北米	米国	46.0%	46.6%	△0.6%
	カナダ	1.9%	2.0%	△0.0%
	計	47.9%	48.6%	△0.6%
中南米	メキシコ	0.7%	0.7%	△0.0%
	計	0.7%	0.7%	△0.0%
欧州	オーストリア	1.4%	1.5%	△0.0%
	ベルギー	2.2%	2.3%	△0.0%
	フィンランド	0.6%	0.6%	△0.0%
	フランス	10.1%	10.3%	△0.2%
	ドイツ	7.3%	7.4%	△0.1%
	アイルランド	0.8%	0.8%	△0.0%
	イタリア	9.2%	9.3%	△0.1%
	オランダ	1.9%	1.9%	△0.0%
	スペイン	5.9%	6.0%	△0.1%
	ユーロ計	39.5%	40.0%	△0.5%
	デンマーク	0.5%	0.5%	△0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	△0.0%	
英国	5.8%	5.9%	△0.1%	
ポーランド	0.5%	0.6%	△0.0%	
ノルウェー	0.2%	0.3%	△0.0%	
計	46.9%	47.5%	△0.6%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	1.8%	1.8%	△0.0%
	シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
	マレーシア	0.4%	0.5%	△0.1%
	計	2.6%	2.7%	△0.1%
中東	イスラエル	0.4%	0.5%	△0.0%
	計	0.0%	0.5%	△0.5%
現金など	1.4%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	

期末

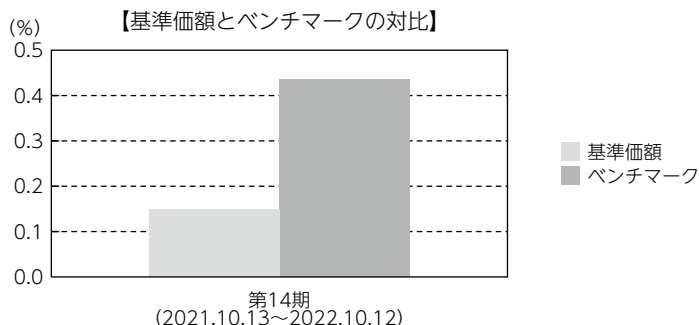
	ファンド	世界国債 インデックス	差	
北米	米国	52.3%	52.4%	△0.1%
	カナダ	2.0%	2.1%	△0.0%
	計	54.3%	54.4%	△0.1%
中南米	メキシコ	0.8%	0.8%	△0.0%
	計	0.8%	0.8%	△0.0%
欧州	オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
	ベルギー	1.8%	1.9%	△0.0%
	フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
	フランス	8.4%	8.6%	△0.1%
	ドイツ	6.2%	6.3%	△0.1%
	アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
	イタリア	7.4%	7.5%	△0.1%
	オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
	スペイン	4.9%	5.0%	△0.1%
	ユーロ計	32.6%	33.1%	△0.6%
	デンマーク	0.3%	0.4%	△0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	0.0%	
英国	3.8%	4.2%	△0.4%	
ポーランド	0.4%	0.4%	△0.0%	
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%	
計	37.6%	38.5%	△1.0%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	1.5%	1.5%	△0.0%
	中国	3.2%	3.3%	△0.1%
	シンガポール	0.4%	0.5%	△0.0%
	マレーシア	0.5%	0.5%	△0.0%
計	5.6%	5.8%	△0.2%	
中東	イスラエル	0.4%	0.4%	△0.0%
	計	0.4%	0.4%	△0.0%
現金など	1.3%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	

(注) 世界国債インデックスとは、FTSE世界国債インデックス (除く日本) です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で0.4%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.3%下回りました。信託報酬等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。



(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運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年10月13日 ～2022年10月12日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	7,439円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第14期		項目の概要
	(2021年10月13日 ～2022年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	58円	0.330%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は17,514円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、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等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(48)	(0.275)	
(販売会社)	(4)	(0.022)	
(受託会社)	(6)	(0.033)	
(b) その他費用	3	0.017	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(2)	(0.013)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	61	0.347	

(注1) 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・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用はこのファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

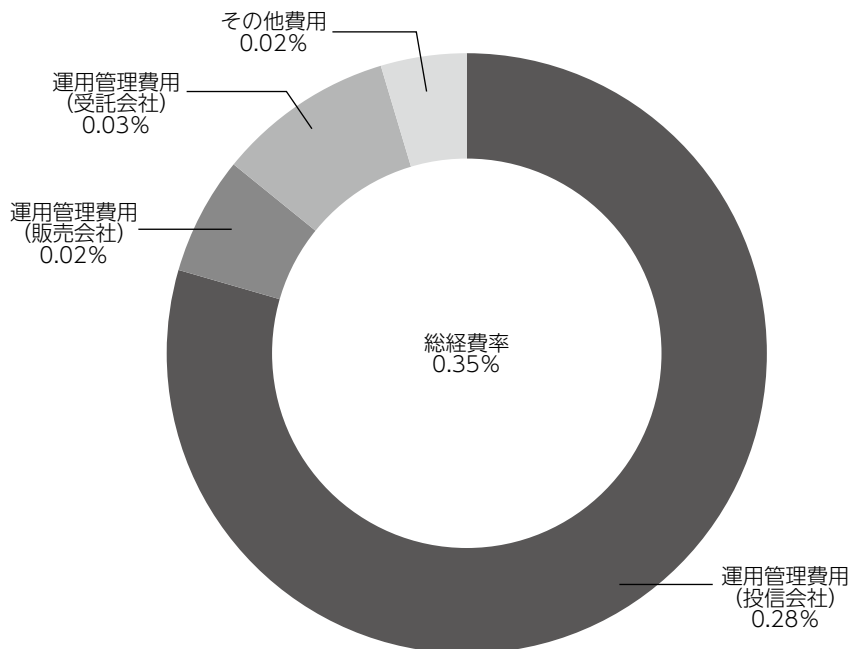
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額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0.35%です。



(注1) 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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年10月13日から2022年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 703,253	千円 1,456,195	千□ 550,882	千円 1,137,191

■利害関係人との取引状況等（2021年10月13日から2022年10月12日まで）

【D I A M外国債券パッシブ・ファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.002	百万円 0.002	% 100.0	百万円 0.002	百万円 0.002	% 100.0

【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0

平均保有割合 9.9%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 7,799,440	千□ 7,951,811	千円 16,446,732

■投資信託財産の構成

2022年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16,446,732	99.8
コール・ローン等、その他	38,439	0.2
投資信託財産総額	16,485,172	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2022年10月12日現在、176,741,904千円、98.1％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=146.20円、1カナダ・ドル=106.01円、1オーストラリア・ドル=91.57円、1シンガポール・ドル=101.61円、1イギリス・ポンド=160.43円、1イスラエル・シェケル=40.79円、1デンマーク・クローネ=19.07円、1ノルウェー・クローネ=13.57円、1スウェーデン・クローナ=12.87円、1メキシコ・ペソ=7.288円、1オフショア・人民元=20.367円、1マレーシア・リンギット=31.268円、1ポーランド・ズロチ=29.231円、1ユーロ=141.84円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	16,485,172,177円
コール・ローン等	33,759,511
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	16,446,732,666
未 収 入 金	4,680,000
(B) 負 債	37,100,885
未 払 解 約 金	9,584,548
未 払 信 託 報 酬	27,217,946
そ の 他 未 払 費 用	298,391
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	16,448,071,292
元 本	9,431,240,294
次 期 繰 越 損 益 金	7,016,830,998
(D) 受 益 権 総 口 数	9,431,240,294口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,440円

(注) 期首における元本額は9,219,608,281円、当期中における追加設定元本額は1,295,802,370円、同解約元本額は1,084,170,357円です。

■損益の状況

当期 自2021年10月13日 至2022年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△6,135円
受 取 利 息	398
支 払 利 息	△6,533
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	67,417,381
売 買 益	85,033,207
売 買 損	△17,615,826
(C) 信 託 報 酬 等	△54,484,057
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	12,927,189
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,440,593,878
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,563,309,931
(配 当 等 相 当 額)	(5,172,452,951)
(売 買 損 益 相 当 額)	(390,856,980)
(G) 合 計(D+E+F)	7,016,830,998
次 期 繰 越 損 益 金(G)	7,016,830,998
追 加 信 託 差 損 益 金	5,563,309,931
(配 当 等 相 当 額)	(5,173,607,909)
(売 買 損 益 相 当 額)	(389,702,022)
分 配 準 備 積 立 金	1,694,265,600
繰 越 損 益 金	△240,744,533

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	253,671,722円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	5,322,565,398
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,440,593,878
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	7,016,830,998
(f) 1万口当たり当期分配対象額	7,439.99
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第19期（決算日 2022年2月21日）

（計算期間 2021年2月23日～2022年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月10日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	期	中	期	中			
	騰	落	騰	落			
	率	率	率	率			
15期 (2018年2月21日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
16期 (2019年2月21日)	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
17期 (2020年2月21日)	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
18期 (2021年2月22日)	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
19期 (2022年2月21日)	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
19期 (2022年2月21日)	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

(注3) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

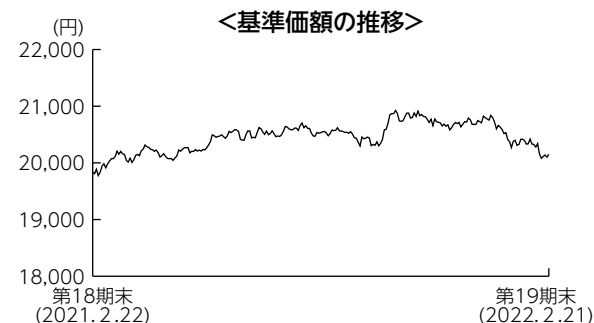
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 率	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 2 月 22 日	円 19,836	% -	ポイント 124,229.95	% -	% 98.4	% -
2 月 末	19,776	△0.3	124,359.44	0.1	99.0	-
3 月 末	20,213	1.9	126,595.03	1.9	95.3	-
4 月 末	20,206	1.9	126,569.17	1.9	97.6	-
5 月 末	20,477	3.2	128,227.80	3.2	98.9	-
6 月 末	20,443	3.1	128,117.08	3.1	97.7	-
7 月 末	20,584	3.8	128,989.36	3.8	98.8	-
8 月 末	20,579	3.7	128,937.19	3.8	98.7	-
9 月 末	20,439	3.0	128,115.00	3.1	98.8	-
10 月 末	20,879	5.3	130,788.36	5.3	98.8	-
11 月 末	20,647	4.1	129,217.14	4.0	98.6	-
12 月 末	20,775	4.7	130,157.13	4.8	99.3	-
2022 年 1 月 末	20,418	2.9	128,015.91	3.0	99.0	-
(期 末) 2022 年 2 月 21 日	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

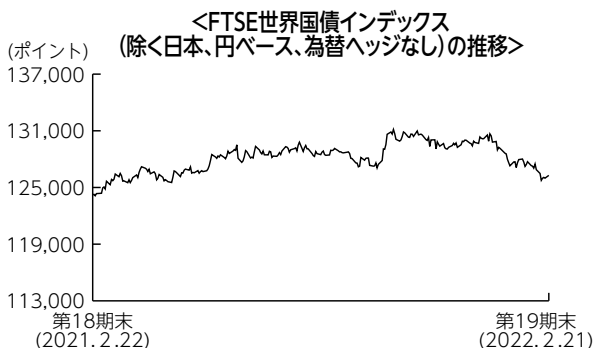


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,152円となり、前期末比で1.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

F O M C（米連邦公開市場委員会）による2022年複数回の利上げ示唆やインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもF O M Cによる早期テーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）や2022年複数回の利上げとの見方から円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことから基準価額は上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、新型コロナウイルスのオミクロン株の重症化リスクが高くない可能性があるという報告やインフレ懸念、F O M Cの早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についてもE C B（欧州中央銀行）がパンデ

ミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、F O M Cの早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて円安ドル高が進みました。ユーロ／円は、E C Bがパンデミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

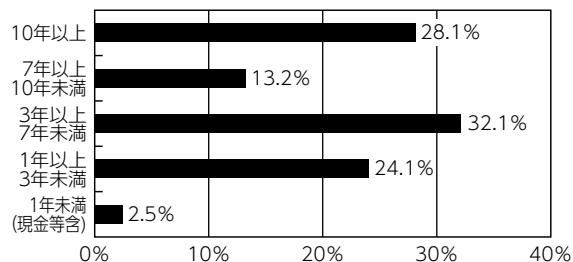
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

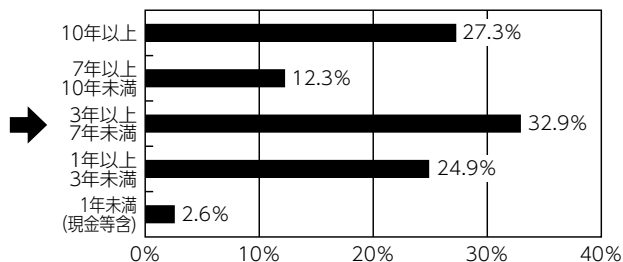
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	42.4%	43.3%	△0.9%
カナダ	2.0%	2.0%	0.0%
計	44.3%	45.2%	△0.9%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.8%	0.0%
計	0.8%	0.8%	0.0%
欧州			
オーストリア	1.5%	1.6%	△0.1%
ベルギー	2.5%	2.6%	△0.1%
フィンランド	0.6%	0.7%	0.0%
フランス	10.6%	10.7%	△0.2%
ドイツ	7.5%	7.7%	△0.2%
アイルランド	0.8%	0.9%	0.0%
イタリア	9.5%	9.8%	△0.3%
オランダ	1.8%	1.9%	△0.1%
スペイン	6.1%	6.1%	0.0%
ユーロ計	40.9%	41.9%	△1.0%
デンマーク	0.5%	0.5%	0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	0.0%
英国	6.6%	6.6%	0.0%
ポーランド	0.6%	0.7%	0.0%
ノルウェー	0.2%	0.3%	0.0%
計	49.2%	50.3%	△1.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	2.8%	2.3%	0.5%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
計	3.6%	3.2%	0.4%
中近東			
イスラエル	0.4%	0.4%	0.0%
計	0.4%	0.4%	0.0%
現金など	1.6%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	47.3%	48.0%	△0.7%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	49.3%	50.0%	△0.7%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.7%	△0.0%
計	0.7%	0.7%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	△0.0%
ベルギー	2.2%	2.2%	△0.0%
フィンランド	0.6%	0.6%	△0.0%
フランス	9.7%	9.8%	△0.1%
ドイツ	7.2%	7.2%	△0.0%
アイルランド	0.8%	0.8%	0.0%
イタリア	8.5%	8.7%	△0.2%
オランダ	1.8%	1.9%	△0.0%
スペイン	5.7%	5.7%	0.0%
ユーロ計	37.8%	38.2%	△0.4%
デンマーク	0.4%	0.4%	0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	△0.0%
英国	5.8%	5.5%	0.3%
ポーランド	0.5%	0.5%	0.0%
ノルウェー	0.2%	0.3%	△0.0%
計	45.0%	45.1%	△0.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.5%	1.6%	△0.0%
中国	0.9%	1.2%	△0.3%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
計	3.4%	3.7%	△0.3%
中近東			
イスラエル	0.4%	0.4%	△0.0%
計	0.4%	0.4%	△0.0%
現金など	1.1%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

(注) 世界国債インデックスとはF T S E世界国債インデックス（除く日本）です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動することをめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.013%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保 管 費 用)	(2)	(0.012)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	3	0.013	
期中の平均基準価額は20,455円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■売買及び取引の状況 (2021年2月23日から2022年2月21日まで)

公社債

			買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 268,986	千アメリカ・ドル 208,086	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 12,930	千カナダ・ドル 11,930	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 9,151	千オーストラリア・ドル 25,829	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,943	千シンガポール・ドル 1,051	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 17,354	千イギリス・ポンド 23,217	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 2,356	千イスラエル・シケル 2,830	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 7,060	千デンマーク・クローネ 8,562	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 4,563	千ノルウェー・クローネ 1,066	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 8,059	千スウェーデン・クローナ 9,098	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 34,009	千メキシコ・ペソ 31,722	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 69,942	千オフショア・人民元 -	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 8,092	千マレーシア・リンギット 3,048	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 6,845	千ポーランド・ズロチ 10,987	
国	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 3,107	千ユーロ 3,037
		オランダ	国債証券	8,961	7,954
		ベルギー	国債証券	8,673	9,501
		フランス	国債証券	35,154	35,216
		ドイツ	国債証券	29,446	28,519
		スペイン	国債証券	20,859	19,722
		イタリア	国債証券	34,035	34,844
		フィンランド	国債証券	1,917	1,829
	オーストリア	国債証券	5,708	5,408	

(注) 金額は受渡代金です(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 (2021年2月23日から2022年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 584,890	千アメリカ・ドル 583,959	千円 67,190,361	% 47.3	% -	% 21.3	% 16.7	% 9.3
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 30,950	千カナダ・ドル 31,321	千円 2,828,620	2.0	-	1.0	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 26,270	千オーストラリア・ドル 26,417	千円 2,185,214	1.5	-	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,070	千シンガポール・ドル 7,353	千円 629,080	0.4	-	0.3	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 45,350	千イギリス・ポンド 52,558	千円 8,228,549	5.8	-	4.4	0.8	0.6
イスラエル	千イスラエル・シケル 15,260	千イスラエル・シケル 16,525	千円 593,263	0.4	-	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 29,720	千デンマーク・クローネ 34,886	千円 611,555	0.4	-	0.4	0.1	-
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 26,720	千ノルウェー・クローネ 26,440	千円 339,233	0.2	-	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 29,060	千スウェーデン・クローナ 31,703	千円 388,054	0.3	-	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 182,626	千メキシコ・ペソ 183,799	千円 1,043,651	0.7	-	0.4	0.2	0.1
中 国	千オフショア・人民元 69,550	千オフショア・人民元 70,200	千円 1,277,451	0.9	-	0.4	0.3	0.2
マレーシア	千マレーシア・リングギット 26,830	千マレーシア・リングギット 27,661	千円 759,920	0.5	-	0.3	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 24,380	千ポーランド・ズロチ 23,028	千円 662,640	0.5	-	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	8,040	8,505	1,108,814	0.8	-	0.6	0.2	0.1
オランダ	17,350	19,673	2,564,646	1.8	-	1.2	0.4	0.2
ベルギー	21,000	23,852	3,109,389	2.2	-	1.6	0.4	0.1
フランス	95,460	106,041	13,823,543	9.7	-	6.2	2.6	0.9
ドイツ	69,560	78,033	10,172,441	7.2	-	4.3	1.9	1.0
スペイン	55,960	61,598	8,030,031	5.7	-	3.6	1.5	0.6
イタリア	85,330	92,683	12,082,236	8.5	-	5.0	2.4	1.0
フィンランド	6,020	6,268	817,158	0.6	-	0.3	0.2	0.1
オーストリア	13,495	14,981	1,952,943	1.4	-	0.9	0.3	0.2
合 計	-	-	千円 140,398,802	98.9	-	53.9	30.0	15.0

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

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当 種 類	利 率	額 面 金 額	期 評 価 額		末 償還年月日
				額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,180	2,246	258,512	2026/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	350	355	40,862	2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	4,980	5,012	576,759	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	3,890	3,965	456,290	2024/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24	国債証券	0.1250	5,000	4,874	560,850	2024/01/15
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	2,490	2,452	282,145	2027/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	3,280	3,250	373,976	2025/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	3,390	3,174	365,233	2028/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	1,500	1,418	163,164	2026/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	840	976	112,356	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	680	768	88,430	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,440	1,624	186,902	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,770	1,816	208,954	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	900	1,068	122,986	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	700	902	103,811	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	630	824	94,919	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,200	1,659	190,943	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,984	228,383	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,070	3,512	404,149	2049/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	550	719	82,811	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	750	1,018	117,206	2040/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	4,770	4,360	501,670	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	2,180	2,165	249,125	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,080	2,127	244,840	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,640	1,845	212,366	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,540	2,886	332,094	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	5,320	5,450	627,135	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	4,300	4,338	499,241	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,110	4,301	494,897	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	2,370	2,484	285,836	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	4,370	4,410	507,447	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,550	3,622	416,791	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,300	1,316	151,436	2024/02/29
US T N/B 1.5 02/28/23	国債証券	1.5000	1,000	1,003	115,513	2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,550	2,616	301,058	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,660	1,710	196,774	2025/02/28
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	1,800	1,827	210,279	2023/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	6,860	6,409	737,420	2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	4,110	3,824	440,015	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,270	3,079	354,288	2050/02/15
US T N/B 1.375 02/15/23	国債証券	1.3750	4,000	4,012	461,696	2023/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,063	122,319	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	2,970	2,881	331,543	2030/02/15
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	4,000	3,894	448,050	2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	1,000	983	113,136	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	3,020	2,889	332,523	2028/02/29
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	2,500	2,372	273,020	2026/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	4,080	4,130	475,221	2024/03/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	2,000	2,007	231,000	2023/03/31	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	2,150	2,209	254,220	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	2,260	2,297	264,403	2026/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	3,020	3,065	352,693	2023/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	1,800	1,694	195,021	2027/03/31	
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	4,810	4,686	539,213	2024/03/15	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	1,300	1,252	144,149	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	2,910	2,801	322,294	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	2,570	2,461	283,275	2026/03/31	
US T N/B 0.5 03/15/23	国債証券	0.5000	2,000	1,986	228,603	2023/03/15	
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	3,000	3,014	346,892	2023/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,760	1,798	206,967	2026/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	2,490	2,534	291,636	2023/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,350	385,452	2024/04/30	
US T N/B 0.25 04/15/23	国債証券	0.2500	2,000	1,978	227,648	2023/04/15	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	3,170	3,049	350,891	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	5,000	4,880	561,546	2024/04/15	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,000	1,868	215,027	2027/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	3,000	2,871	330,348	2026/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,000	1,916	220,510	2025/04/30	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	710	945	108,785	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	800	1,058	121,762	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,040	1,378	158,590	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	980	1,087	125,135	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	810	1,051	121,019	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	1,900	2,061	237,247	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	4,300	4,403	506,624	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,530	1,799	207,027	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	500	556	64,083	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,290	1,455	167,456	2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,810	1,857	213,700	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	1,630	1,896	218,229	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	2,100	1,727	198,775	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,090	3,463	398,477	2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	540	717	82,505	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	3,890	3,839	441,813	2041/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	2,620	2,636	303,364	2023/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	4,240	4,328	497,992	2024/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,320	3,361	386,804	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,430	4,683	538,845	2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	2,810	2,899	333,573	2029/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,700	4,824	555,104	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	500	692	79,692	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	3,090	3,067	352,896	2026/05/15	
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	2,900	2,913	335,277	2023/05/31	
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	4,770	4,816	554,195	2024/05/31	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	3,780	2,961	340,805	2050/05/15	
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,050	2,075	238,821	2026/05/31	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	6,740	6,567	755,601	2031/05/15	
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,331	383,330	2023/05/31	
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	2,530	2,620	301,472	2025/05/31	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,500	1,398	160,926	2027/05/31
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	3,000	2,960	340,582	2023/05/15
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,000	3,844	442,351	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	2,000	1,943	223,611	2024/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	4,220	3,807	438,060	2030/05/15
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	3,000	2,868	330,051	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	4,470	4,257	489,888	2025/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	3,460	3,461	398,325	2023/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	790	815	93,823	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	1,450	1,453	167,188	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	1,820	1,851	213,090	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,345	154,794	2024/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	1,540	1,434	165,079	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,000	2,881	331,507	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/15/23	国債証券	0.2500	2,800	2,762	317,851	2023/06/15
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,852	328,217	2025/06/30
US T N/B 0.25 06/15/24	国債証券	0.2500	3,780	3,666	421,912	2024/06/15
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	3,310	3,180	365,912	2026/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	1,860	1,928	221,936	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,370	2,375	273,331	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	3,690	3,704	426,196	2024/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,336	383,859	2023/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	1,600	1,573	181,003	2023/07/15
US T N/B 0.125 07/31/23	国債証券	0.1250	2,640	2,594	298,501	2023/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	3,000	2,833	326,019	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,500	3,234	372,176	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	1,000	949	109,262	2025/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	3,200	3,037	349,465	2026/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,072	123,419	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	710	871	100,296	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,110	1,379	158,727	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	430	458	52,757	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	1,750	1,982	228,144	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	790	1,056	121,546	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,170	1,420	163,489	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	3,690	3,475	399,893	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	740	809	93,126	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	2,680	2,700	310,769	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	1,880	2,034	234,124	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	1,490	1,479	170,247	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	4,330	4,405	506,928	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	3,920	3,993	459,456	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	1,710	1,675	192,809	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,710	3,085	355,027	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,530	2,583	297,208	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,090	3,047	350,619	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	3,730	3,948	454,270	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,640	1,694	194,934	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,380	3,316	381,610	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	820	825	94,960	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	2,170	2,214	254,829	2023/08/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	3,570	3,241	372,977	2041/08/15	
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	3,500	2,867	329,970	2040/08/15	
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,040	3,267	375,941	2050/08/15	
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	7,160	6,739	775,493	2031/08/15	
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	5,920	5,322	612,401	2030/08/15	
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	1,079	124,173	2026/08/31	
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,440	2,417	278,180	2024/08/31	
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	1,000	947	109,055	2025/08/31	
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	3,500	3,396	390,848	2024/08/15	
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,963	225,931	2023/08/15	
US T N/B 0.125 08/31/23	国債証券	0.1250	530	520	59,850	2023/08/31	
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,000	2,853	328,352	2028/08/31	
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	4,340	4,030	463,722	2027/08/31	
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	4,000	3,814	438,917	2026/08/31	
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,410	1,470	169,205	2025/09/30	
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,930	2,966	341,339	2024/09/30	
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	1,500	1,499	172,549	2023/09/30	
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	840	859	98,938	2023/09/30	
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,961	225,697	2023/09/15	
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	1,050	967	111,270	2027/09/30	
US T N/B 0.25 09/30/23	国債証券	0.2500	2,500	2,455	282,514	2023/09/30	
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,900	1,883	216,718	2026/09/30	
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	3,000	2,875	330,846	2028/09/30	
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,840	326,815	2025/09/30	
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	2,370	2,270	261,294	2026/09/30	
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	2,000	1,937	222,946	2024/09/15	
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	2,000	2,031	233,787	2024/10/31	
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,920	2,002	230,442	2025/10/31	
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	4,500	4,514	519,388	2023/10/31	
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	3,690	3,779	434,853	2023/10/31	
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	1,350	1,338	153,996	2026/10/31	
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,000	3,862	444,455	2028/10/31	
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,200	2,191	252,123	2024/10/31	
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,000	2,778	319,655	2027/10/31	
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	2,000	1,937	222,892	2026/10/31	
US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	0.6250	3,500	3,410	392,359	2024/10/15	
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	2,000	1,890	217,463	2025/10/31	
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	1,030	118,560	2028/11/15	
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	900	1,108	127,573	2027/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,790	1,990	229,031	2044/11/15	
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	510	663	76,330	2040/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,220	1,300	149,607	2042/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	760	857	98,608	2041/11/15	
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,360	1,682	193,639	2043/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,140	2,316	266,523	2047/11/15	
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	4,400	3,786	435,703	2050/11/15	
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	3,700	3,389	389,951	2051/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	650	726	83,611	2045/11/15	
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	920	1,011	116,391	2046/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	4,690	4,768	548,611	2024/11/15	
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	910	1,199	138,021	2039/11/15	

銘柄	当	期				末		
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額			邦貨換算金額
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	2,660	3,242	373,069	2048/11/15		
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	2,827	325,339	2049/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	4,690	4,767	548,526	2025/11/15		
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	3,670	3,949	454,385	2028/11/15		
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	5,520	5,642	649,272	2023/11/15		
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,140	2,157	248,248	2026/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,335	383,829	2027/11/15		
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	2,000	2,023	232,852	2023/11/30		
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	2,810	2,401	276,361	2040/11/15		
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	1,770	1,678	193,091	2041/11/15		
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,794	206,452	2026/11/30		
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	1,940	1,919	220,879	2029/11/15		
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	3,520	3,344	384,823	2031/11/15		
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	6,000	5,497	632,515	2030/11/15		
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	2,000	1,862	214,326	2027/11/30		
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	2,000	1,948	224,196	2026/11/30		
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	2,000	1,946	223,971	2028/11/30		
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	2,000	1,991	229,167	2024/11/30		
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	2,590	2,456	282,592	2025/11/30		
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	1,490	1,454	167,340	2024/11/15		
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,124	359,482	2023/12/31		
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,361	271,659	2025/12/31		
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	3,048	350,735	2024/12/31		
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	1,740	1,735	199,641	2026/12/31		
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,952	224,672	2023/12/15		
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	1,390	1,353	155,753	2026/12/31		
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,600	1,603	184,484	2024/12/31		
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	1,500	1,447	166,596	2028/12/31		
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,841	326,950	2025/12/31		
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	2,430	2,260	260,078	2027/12/31		
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	3,710	3,643	419,185	2024/12/15		
小計	-	-	584,890	583,959	67,190,361	-		
(カナダ)			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 0.25 02/01/23	国債証券	0.2500	500	495	44,751	2023/02/01		
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	200	197	17,807	2024/02/01		
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	537	48,581	2024/03/01		
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	460	462	41,759	2023/03/01		
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	692	62,548	2025/03/01		
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,300	1,228	110,932	2026/03/01		
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	400	390	35,242	2027/03/01		
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,461	131,967	2024/04/01		
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	1,000	988	89,230	2023/05/01		
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	695	62,790	2026/06/01		
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,000	1,271	114,826	2029/06/01		
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	520	715	64,624	2033/06/01		
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	390	535	48,333	2037/06/01		
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,550	1,583	143,008	2024/06/01		
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	540	695	62,770	2041/06/01		
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,212	109,543	2023/06/01		
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	420	426	38,543	2028/06/01		
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	900	918	82,937	2025/06/01		

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	700	675	60,979	2027/06/01	
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	630	56,956	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	1,810	1,734	156,601	2030/06/01	
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	1,970	1,907	172,277	2031/06/01	
CANADA 0.25 08/01/23	国債証券	0.2500	700	689	62,232	2023/08/01	
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	440	439	39,675	2024/09/01	
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	880	888	80,238	2023/09/01	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,550	1,488	134,402	2025/09/01	
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,070	1,036	93,644	2026/09/01	
CANADA 0.5 11/01/23	国債証券	0.5000	620	610	55,141	2023/11/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	610	759	68,622	2045/12/01	
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	580	648	58,602	2048/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,430	2,348	212,098	2051/12/01	
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	710	639	57,733	2053/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	400	36,137	2064/12/01	
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,500	1,338	120,867	2030/12/01	
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	600	578	52,208	2031/12/01	
小計	—	—	30,950	31,321	2,828,620	—	
(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		
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	760	785	64,983	2047/03/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	190	199	16,492	2025/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	1,480	1,528	126,464	2024/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	1,810	1,985	164,228	2026/04/21	
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	1,120	1,181	97,774	2023/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,000	1,075	88,946	2029/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	880	1,073	88,815	2033/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	760	879	72,734	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	800	810	67,006	2028/05/21	
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,550	1,587	131,338	2030/05/21	
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	740	743	61,485	2041/05/21	
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	990	900	74,452	2032/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	620	672	55,650	2039/06/21	
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	1,300	1,221	101,046	2031/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	530	550	45,578	2035/06/21	
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	930	736	60,943	2051/06/21	
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	310	291	24,079	2026/09/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	1,160	1,208	99,940	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,630	1,697	140,408	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,260	1,316	108,875	2029/11/21	
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	900	855	70,797	2032/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	1,600	1,427	118,110	2031/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,450	1,370	113,335	2025/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	940	908	75,142	2024/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,560	1,409	116,583	2030/12/21	
小計	—	—	26,270	26,417	2,185,214	—	
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	280	284	24,320	2024/02/01	
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	200	201	17,243	2023/02/01	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	730	789	67,560	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	420	465	39,811	2046/03/01	
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	440	412	35,308	2050/03/01	

銘	柄	当期					末	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	380	418	35,777	2042/04/01		
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	380	396	33,923	2028/05/01		
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	340	350	29,947	2025/06/01		
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	420	428	36,631	2026/06/01		
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	470	500	42,793	2029/07/01		
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	180	185	15,907	2039/07/01		
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	700	715	61,239	2023/07/01		
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	200	193	16,586	2031/07/01		
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	480	486	41,584	2036/08/01		
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	550	572	48,948	2024/09/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	370	395	33,869	2030/09/01		
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	280	316	27,103	2033/09/01		
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	50	47	4,041	2051/10/01		
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	200	192	16,482	2025/11/01		
小計	-	-	7,070	7,353	629,080	-		
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	910	1,198	187,615	2044/01/22		
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,080	1,487	232,834	2045/01/22		
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	770	1,369	214,476	2060/01/22		
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	510	537	84,226	2049/01/22		
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	760	657	102,874	2046/01/31		
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	390	365	57,179	2039/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	1,800	1,760	275,652	2024/01/31		
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	400	378	59,298	2029/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	500	468	73,305	2028/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	1,500	1,486	232,735	2023/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	800	766	119,924	2026/01/30		
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,310	1,455	227,867	2025/03/07		
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	890	1,197	187,505	2036/03/07		
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	1,470	1,462	229,020	2024/04/22		
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,010	1,283	200,906	2032/06/07		
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	750	735	115,172	2025/06/07		
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,030	1,025	160,497	2047/07/22		
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	390	367	57,480	2051/07/31		
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	870	1,352	211,735	2052/07/22		
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,210	1,322	207,050	2057/07/22		
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	980	1,365	213,801	2065/07/22		
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	960	1,692	264,929	2068/07/22		
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	800	809	126,754	2026/07/22		
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	700	701	109,749	2027/07/22		
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	960	954	149,441	2023/07/22		
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	450	423	66,261	2033/07/31		
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,600	1,440	225,486	2031/07/31		
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	800	711	111,373	2035/07/31		
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	720	1,022	160,094	2039/09/07		
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	980	994	155,756	2023/09/07		
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	480	497	77,913	2024/09/07		
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	790	810	126,909	2025/09/07		
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	860	1,154	180,758	2034/09/07		
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,140	1,171	183,379	2037/09/07		
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	540	564	88,306	2054/10/22		

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	970	724	113,407	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	500	571	89,527	2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	1,040	985	154,333	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	360	289	45,252	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	930	953	149,261	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	910	883	138,310	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	600	553	86,710	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	1,130	1,083	169,622	2026/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	560	732	114,725	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	880	1,302	203,854	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	980	1,496	234,327	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,000	1,557	243,803	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,020	1,784	279,345	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	780	910	142,526	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	860	1,240	194,254	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	870	1,118	175,105	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	850	1,379	215,906	2049/12/07
小 計	—	—	45,350	52,558	8,228,549	—
(イスラエル)		%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	1,300	1,939	69,626	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,390	1,668	59,882	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	2,610	2,729	97,979	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	2,100	2,237	80,332	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	1,350	1,299	46,637	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	2,320	2,422	86,951	2023/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	1,000	906	32,543	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,030	2,091	75,096	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	1,160	1,231	44,214	2028/09/28
小 計	—	—	15,260	16,525	593,263	—
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	2,020	1,812	31,777	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	7,580	12,594	220,783	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	5,320	5,663	99,274	2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	7,130	7,244	126,993	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	4,370	4,426	77,595	2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	3,300	3,144	55,131	2031/11/15
小 計	—	—	29,720	34,886	611,555	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	3,770	3,706	47,558	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	1,900	1,878	24,102	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	5,800	5,950	76,342	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,800	3,784	48,551	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	2,064	26,486	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	1,800	1,814	23,276	2023/05/24
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	3,730	3,529	45,283	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	2,750	2,691	34,538	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	1,100	1,020	13,095	2031/09/17
小 計	—	—	26,720	26,440	339,233	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,270	4,718	57,750	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	1,840	1,865	22,828	2028/05/12

銘柄	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)			%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	7,980	8,544	104,583	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	2,150	2,061	25,236	2031/05/12	
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	3,147	38,531	2032/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	4,700	4,821	59,017	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	3,250	3,330	40,769	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,170	3,213	39,335	2029/11/12	
小計	—	—	29,060	31,703	388,054	—	
(メキシコ)			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	22,143	20,617	117,071	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	8,000	7,945	45,118	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	17,109	17,831	101,253	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	17,000	16,945	96,218	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	17,883	101,546	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	18,000	18,103	102,793	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	11,643	11,266	63,973	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	12,654	12,543	71,223	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	13,125	13,738	78,010	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,085	6,015	34,156	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	6,000	5,948	33,775	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	19,796	20,900	118,678	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	14,059	79,832	2023/12/07	
小計	—	—	182,626	183,799	1,043,651	—	
(中国)			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	1,100	1,166	21,228	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,000	5,914	107,628	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	17,000	17,130	311,720	2026/08/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	5,000	5,024	91,437	2024/09/02	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	4,950	5,121	93,188	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	14,500	14,631	266,248	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	国債証券	2.5600	15,000	15,083	274,470	2023/10/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	3,000	3,023	55,026	2031/11/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	3,000	3,104	56,500	2027/12/03	
小計	—	—	69,550	70,200	1,277,451	—	
(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	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	817	22,469	2027/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,239	34,042	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,208	88,140	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	1,898	52,164	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,204	33,102	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,400	1,518	41,716	2037/04/07	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,000	917	25,192	2031/04/15	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,015	55,366	2028/06/15	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,000	1,016	27,921	2024/06/14	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,505	68,829	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	2,700	2,849	78,268	2048/07/06	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,700	1,666	45,788	2034/07/05	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	2,700	2,785	76,521	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,153	59,172	2043/09/30	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	500	513	14,096	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	800	819	22,508	2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	500	532	14,619	2033/11/07	
小計	—	—	26,830	27,661	759,920	—	

銘	柄	当 期				末	
		種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ポーランド)			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,613	46,426	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	2,910	2,738	78,807	2028/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,240	64,471	2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	2,680	2,451	70,538	2025/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,180	2,068	59,511	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,343	67,436	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,250	2,097	60,362	2027/07/25	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	2,740	2,760	79,430	2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	210	194	5,590	2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	1,000	967	27,838	2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,900	2,362	67,981	2030/10/25	
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,400	1,190	34,246	2026/10/25	
小 計	-	-	24,380	23,028	662,640	-	
(ユーロ…アイルランド)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	600	715	93,311	2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	270	289	37,710	2031/03/18	
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	320	344	44,947	2024/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	710	831	108,340	2025/03/13	
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	570	596	77,813	2023/03/20	
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	220	201	26,216	2041/04/22	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	420	448	58,429	2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	340	358	46,691	2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	630	729	95,067	2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	390	405	52,905	2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	520	544	71,027	2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	640	666	86,860	2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	390	431	56,310	2037/05/15	
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	350	327	42,749	2035/05/15	
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	560	560	73,123	2027/05/15	
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	660	616	80,393	2031/10/18	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	450	436	56,912	2030/10/18	
小 計	-	-	8,040	8,505	1,108,814	-	
(ユーロ…オランダ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,130	1,820	237,294	2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,140	1,731	225,699	2047/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	610	507	66,184	2052/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	850	1,107	144,358	2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,060	1,590	207,300	2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	980	1,197	156,063	2033/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	400	366	47,727	2038/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	630	628	81,879	2040/01/15	
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	1,310	1,321	172,313	2024/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	270	265	34,662	2029/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	920	918	119,747	2027/01/15	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	450	464	60,613	2023/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,130	1,155	150,680	2026/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,130	1,194	155,728	2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,280	1,298	169,317	2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	980	1,019	132,861	2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,000	1,038	135,341	2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	790	792	103,283	2029/07/15	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	750	732	95,503	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	540	522	68,087	2031/07/15
小 計	—	—	17,350	19,673	2,564,646	—
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	1,190	1,579	205,883	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,110	1,726	225,101	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	430	511	66,618	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	730	975	127,215	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	890	1,356	176,852	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	710	757	98,749	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	520	802	104,603	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	670	730	95,183	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	670	742	96,847	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	350	442	57,642	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	420	528	68,887	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	330	239	31,190	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,110	1,156	150,786	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	1,020	1,089	142,056	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	930	967	126,153	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	830	860	112,180	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	670	692	90,232	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	430	384	50,166	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,050	1,091	142,303	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	590	745	97,225	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	520	597	77,842	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,140	1,175	153,216	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	840	869	113,351	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	440	473	61,703	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	800	774	101,002	2030/06/22
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	670	684	89,179	2024/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	770	724	94,451	2031/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	660	667	86,984	2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	510	504	65,775	2027/10/22
小 計	—	—	21,000	23,852	3,109,389	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	国債証券	0.0000	900	905	118,033	2023/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	900	893	116,427	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	2,460	2,459	320,568	2026/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	1,150	1,158	151,067	2024/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	2,520	2,538	330,929	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	2,970	2,982	388,857	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	2,200	2,214	288,740	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,030	1,139	148,583	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	2,520	2,885	376,190	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,250	3,645	475,175	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,260	2,208	287,887	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	730	1,332	173,752	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	2,540	3,473	452,785	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,550	2,325	303,111	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	1,600	2,317	302,054	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,690	2,027	264,241	2048/05/25

銘柄	当期				期末		償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	2,000	2,153	280,743	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	1,890	1,661	216,658	2052/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	650	564	73,560	2053/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	820	934	121,829	2066/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	600	409	53,334	2072/05/25	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	1,980	2,095	273,231	2024/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	3,240	3,783	493,197	2030/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	3,270	3,369	439,218	2028/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,090	3,351	436,918	2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	2,490	2,541	331,291	2025/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	2,220	2,240	292,119	2029/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,540	2,676	348,849	2034/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	2,770	2,823	368,124	2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	2,460	2,568	334,893	2027/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,270	1,168	152,287	2040/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	2,530	2,604	339,501	2023/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	2,590	2,716	354,108	2036/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	1,690	1,931	251,834	2039/06/25	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	740	658	85,778	2044/06/25	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	3,130	3,379	440,558	2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	1,800	2,207	287,769	2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	2,840	3,255	424,434	2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,630	2,424	315,993	2038/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,100	3,213	418,890	2032/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,380	2,511	327,439	2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,220	2,306	300,662	2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,150	2,164	282,208	2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	2,420	2,490	324,648	2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	2,330	2,190	285,531	2031/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	2,800	2,670	348,092	2030/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,550	2,465	321,428	2029/11/25	
小計	—	—	95,460	106,041	13,823,543	—	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	840	948	123,666	2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,160	1,551	202,289	2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	710	1,060	138,228	2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,240	1,840	239,989	2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,640	2,539	331,104	2037/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,660	1,702	221,937	2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	1,810	1,860	242,473	2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,390	1,413	184,200	2029/02/15	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	920	939	122,528	2023/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,640	1,691	220,524	2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,750	1,830	238,578	2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	1,960	1,994	260,015	2027/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	1,660	1,640	213,861	2031/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,690	1,680	219,101	2030/02/15	
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	1,030	1,037	135,296	2023/04/14	
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,540	1,555	202,804	2024/04/05	
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,250	1,261	164,486	2025/04/11	
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	1,430	1,440	187,818	2026/04/10	

銘柄	当	期				末		
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額			邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,950	2,035	265,395	2024/05/15		
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	1,650	1,693	220,794	2023/05/15		
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,200	1,150	149,983	2035/05/15		
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,350	1,282	167,216	2036/05/15		
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	710	962	125,497	2027/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,100	1,438	187,564	2028/07/04		
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	940	1,571	204,821	2039/07/04		
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	890	1,406	183,381	2042/07/04		
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	1,760	2,588	337,393	2044/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,140	2,048	267,093	2040/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,660	2,590	337,716	2034/07/04		
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	1,890	2,844	370,749	2046/08/15		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	340	293	38,310	2052/08/15		
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	1,820	2,202	287,112	2048/08/15		
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	1,470	1,534	200,020	2025/08/15		
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,000	2,061	268,687	2027/08/15		
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,680	1,691	220,559	2026/08/15		
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,810	1,840	239,894	2028/08/15		
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	2,930	3,045	397,055	2023/08/15		
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,340	1,387	180,840	2024/08/15		
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,610	1,605	209,236	2029/08/15		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,720	1,515	197,499	2050/08/15		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	700	688	89,817	2031/08/15		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	400	354	46,263	2050/08/15		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,000	1,983	258,522	2030/08/15		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	500	497	64,872	2030/08/15		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	450	444	57,879	2031/08/15		
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,130	1,141	148,776	2024/10/18		
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	1,280	1,292	168,527	2023/10/13		
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	1,050	1,056	137,737	2026/10/09		
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,400	1,412	184,079	2025/10/10		
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	670	677	88,267	2025/10/10		
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,200	1,202	156,812	2027/11/15		
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	500	499	65,155	2028/11/15		
小計	-	-	69,560	78,033	10,172,441	-		
(ユーロ…スペイン)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,580	2,146	279,779	2029/01/31		
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,130	1,239	161,636	2024/01/31		
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,100	1,516	197,750	2037/01/31		
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,160	1,224	159,683	2023/01/31		
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,400	1,397	182,120	2025/01/31		
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	350	340	44,369	2027/01/31		
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,160	1,113	145,100	2028/01/31		
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	800	789	102,872	2026/01/31		
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,450	1,519	198,019	2025/04/30		
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,190	1,293	168,562	2024/04/30		
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,240	1,300	169,567	2027/04/30		
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,270	1,353	176,490	2026/04/30		
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,440	1,504	196,136	2028/04/30		
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,170	1,223	159,528	2029/04/30		
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	610	580	75,615	2032/04/30		

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,850	1,793	233,770	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,190	1,087	141,787	2031/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	990	995	129,797	2023/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	860	860	112,236	2024/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,370	1,703	222,091	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	970	1,494	194,794	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,250	1,907	248,683	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	920	1,238	161,501	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,370	1,577	205,608	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,460	1,580	206,074	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,220	1,776	231,601	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,240	1,383	180,316	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,310	1,367	178,225	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,200	1,268	165,354	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	1,240	1,249	162,917	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,420	1,434	187,009	2023/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	600	544	70,953	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	130	115	15,067	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,200	1,211	157,965	2027/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	1,540	1,655	215,832	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,030	1,326	172,940	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	910	1,514	197,484	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,060	1,310	170,797	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	930	1,112	145,026	2048/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	300	227	29,687	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,170	950	123,969	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,380	1,475	192,408	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,500	1,570	204,667	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,460	1,520	198,168	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,180	1,159	151,089	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	1,110	1,198	156,228	2023/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,100	1,036	135,128	2031/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,080	1,005	131,124	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,370	1,399	182,486	2030/10/31
小計	-	-	55,960	61,598	8,030,031	-
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,300	1,291	168,400	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	1,000	998	130,164	2024/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,280	1,783	232,520	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,660	2,072	270,150	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,430	1,497	195,200	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,080	1,075	140,225	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,400	1,386	180,688	2026/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,120	1,190	155,201	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,020	1,227	159,980	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,390	1,512	197,148	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	590	597	77,858	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	320	272	35,457	2072/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,790	2,031	264,838	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,630	1,872	244,062	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	1,320	1,307	170,477	2032/03/01

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	期		末				
									評			額	償		
									外	貨				建	金
(ユーロ…イタリア)					%		千	ユー	口	千	ユー	口	千	円	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国	債	証	券	3.1000	820			929				121,160		2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国	債	証	券	3.3500	1,010			1,168				152,264		2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国	債	証	券	3.5000	1,540			1,774				231,373		2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国	債	証	券	0.9500	1,070			1,084				141,403		2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国	債	証	券	0.9500	920			932				121,560		2023/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国	債	証	券	1.4500	900			839				109,392		2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国	債	証	券	1.8000	770			715				93,310		2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国	債	証	券	0.9500	900			771				100,534		2037/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国	債	証	券	0.2500	1,080			1,017				132,594		2028/03/15
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国	債	証	券	1.5000	590			504				65,821		2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国	債	証	券	1.3500	1,110			1,093				142,518		2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国	債	証	券	0.9000	1,000			930				121,342		2031/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国	債	証	券	0.0000	1,000			994				129,643		2024/04/15
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国	債	証	券	0.0000	990			956				124,655		2026/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国	債	証	券	6.0000	1,470			2,019				263,279		2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国	債	証	券	4.5000	1,400			1,480				192,978		2023/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国	債	証	券	1.8500	810			839				109,403		2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国	債	証	券	1.4500	1,340			1,378				179,643		2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国	債	証	券	1.6000	1,100			1,135				148,013		2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国	債	証	券	1.5000	1,460			1,504				196,073		2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国	債	証	券	2.2000	920			974				127,019		2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国	債	証	券	0.9500	240			220				28,724		2032/06/01
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	国	債	証	券	0.6000	500			505				65,929		2023/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国	債	証	券	2.1000	680			716				93,373		2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国	債	証	券	1.7500	1,200			1,239				161,638		2024/07/01
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国	債	証	券	0.5000	500			475				61,960		2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国	債	証	券	1.8500	900			937				122,157		2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国	債	証	券	5.0000	1,610			2,160				281,700		2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国	債	証	券	5.0000	1,330			1,875				244,464		2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国	債	証	券	4.7500	1,900			2,034				265,239		2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国	債	証	券	2.0500	1,040			1,092				142,411		2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国	債	証	券	3.0000	1,330			1,478				192,718		2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国	債	証	券	0.6000	1,610			1,450				189,092		2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国	債	証	券	0.9500	1,170			1,107				144,315		2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国	債	証	券	0.3000	1,000			1,006				131,207		2023/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国	債	証	券	0.0000	600			576				75,134		2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国	債	証	券	2.9500	940			1,041				135,760		2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国	債	証	券	4.7500	970			1,387				180,919		2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国	債	証	券	3.2500	990			1,153				150,425		2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国	債	証	券	4.7500	1,680			2,044				266,502		2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国	債	証	券	5.0000	1,390			1,982				258,409		2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国	債	証	券	2.4500	970			968				126,221		2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国	債	証	券	1.7000	900			761				99,299		2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国	債	証	券	2.4500	1,140			1,209				157,653		2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国	債	証	券	2.1500	400			371				48,394		2052/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国	債	証	券	3.7500	1,210			1,313				171,238		2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国	債	証	券	3.8500	570			731				95,390		2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国	債	証	券	2.2500	690			707				92,242		2036/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国	債	証	券	0.9500	1,430			1,417				184,755		2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国	債	証	券	0.6500	980			991				129,249		2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国	債	証	券	2.4500	930			967				126,187		2023/10/01

銘	柄	当				期		末										
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日			
									外	貨						建	金	額
(ユーロ…イタリア)					%	千	ユ	ー	口	千	ユ	ー	口	千	円			
ITALY	BTPS	9.0	11/01/23	国	債	証	券	9.0000	1,190	1,370	178,690	2023/11/01						
ITALY	BTPS	7.25	11/01/26	国	債	証	券	7.2500	350	452	58,980	2026/11/01						
ITALY	BTPS	6.5	11/01/27	国	債	証	券	6.5000	1,790	2,321	302,647	2027/11/01						
ITALY	BTPS	5.25	11/01/29	国	債	証	券	5.2500	2,050	2,626	342,385	2029/11/01						
ITALY	BTPS	1.45	11/15/24	国	債	証	券	1.4500	1,040	1,068	139,252	2024/11/15						
ITALY	BTPS	2.5	11/15/25	国	債	証	券	2.5000	550	586	76,490	2025/11/15						
ITALY	BTPS	2.0	12/01/25	国	債	証	券	2.0000	970	1,017	132,608	2025/12/01						
ITALY	BTPS	1.25	12/01/26	国	債	証	券	1.2500	1,230	1,249	162,836	2026/12/01						
ITALY	BTPS	2.5	12/01/24	国	債	証	券	2.5000	1,170	1,236	161,223	2024/12/01						
ITALY	BTPS	2.8	12/01/28	国	債	証	券	2.8000	1,000	1,096	142,937	2028/12/01						
ITALY	BTPS	0.95	12/01/31	国	債	証	券	0.9500	1,180	1,093	142,509	2031/12/01						
ITALY	BTPS	1.65	12/01/30	国	債	証	券	1.6500	1,480	1,477	192,595	2030/12/01						
小	計	-	-	-	-	-	-	-	85,330	92,683	12,082,236	-						
(ユーロ…フィンランド)					%	千	ユ	ー	口	千	ユ	ー	口	千	円			
FINLAND	0.125	04/15/52	国	債	証	券	0.1250	220	177	23,186	2052/04/15							
FINLAND	2.0	04/15/24	国	債	証	券	2.0000	260	273	35,684	2024/04/15							
FINLAND	0.75	04/15/31	国	債	証	券	0.7500	250	256	33,383	2031/04/15							
FINLAND	1.375	04/15/47	国	債	証	券	1.3750	280	318	41,553	2047/04/15							
FINLAND	0.5	04/15/26	国	債	証	券	0.5000	490	500	65,291	2026/04/15							
FINLAND	1.125	04/15/34	国	債	証	券	1.1250	290	306	39,982	2034/04/15							
FINLAND	1.5	04/15/23	国	債	証	券	1.5000	470	481	62,729	2023/04/15							
FINLAND	0.125	04/15/36	国	債	証	券	0.1250	260	238	31,114	2036/04/15							
FINLAND	4.0	07/04/25	国	債	証	券	4.0000	430	491	64,026	2025/07/04							
FINLAND	2.75	07/04/28	国	債	証	券	2.7500	420	488	63,688	2028/07/04							
FINLAND	2.625	07/04/42	国	債	証	券	2.6250	250	339	44,288	2042/07/04							
FINLAND	0.5	09/15/29	国	債	証	券	0.5000	370	374	48,819	2029/09/15							
FINLAND	0.875	09/15/25	国	債	証	券	0.8750	330	341	44,573	2025/09/15							
FINLAND	0.5	09/15/28	国	債	証	券	0.5000	100	101	13,230	2028/09/15							
FINLAND	0.5	09/15/27	国	債	証	券	0.5000	500	510	66,608	2027/09/15							
FINLAND	09/15/23		国	債	証	券	0.0000	280	282	36,810	2023/09/15							
FINLAND	0.25	09/15/40	国	債	証	券	0.2500	230	208	27,147	2040/09/15							
FINLAND	0.125	09/15/31	国	債	証	券	0.1250	240	230	30,093	2031/09/15							
FINLAND	0.0	09/15/30	国	債	証	券	0.0000	170	163	21,288	2030/09/15							
FINLAND	0.0	09/15/24	国	債	証	券	0.0000	180	181	23,654	2024/09/15							
小	計	-	-	-	-	-	-	-	6,020	6,268	817,158	-						
(ユーロ…オーストリア)					%	千	ユ	ー	口	千	ユ	ー	口	千	円			
AUSTRIA	3.8	01/26/62	国	債	証	券	3.8000	210	398	51,885	2062/01/26							
AUSTRIA	1.5	02/20/47	国	債	証	券	1.5000	430	490	63,891	2047/02/20							
AUSTRIA	0.5	02/20/29	国	債	証	券	0.5000	770	778	101,527	2029/02/20							
AUSTRIA	0.75	02/20/28	国	債	証	券	0.7500	775	799	104,275	2028/02/20							
AUSTRIA	0.0	02/20/31	国	債	証	券	0.0000	530	505	65,876	2031/02/20							
AUSTRIA	0.0	02/20/30	国	債	証	券	0.0000	690	666	86,824	2030/02/20							
AUSTRIA	4.85	03/15/26	国	債	証	券	4.8500	740	890	116,106	2026/03/15							
AUSTRIA	4.15	03/15/37	国	債	証	券	4.1500	890	1,328	173,218	2037/03/15							
AUSTRIA	0.75	03/20/51	国	債	証	券	0.7500	290	274	35,831	2051/03/20							
AUSTRIA	0.7	04/20/71	国	債	証	券	0.7000	250	203	26,524	2071/04/20							
AUSTRIA	0.5	04/20/27	国	債	証	券	0.5000	650	664	86,564	2027/04/20							
AUSTRIA	0.0	04/20/23	国	債	証	券	0.0000	200	201	26,239	2023/04/20							
AUSTRIA	0.0	04/20/25	国	債	証	券	0.0000	70	70	9,164	2025/04/20							
AUSTRIA	2.4	05/23/34	国	債	証	券	2.4000	680	821	107,048	2034/05/23							
AUSTRIA	0.85	06/30/20	国	債	証	券	0.8500	250	183	23,878	2120/06/30							

銘柄	当 期				末	
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国 債 証 券	3.1500	470	695	90,658	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国 債 証 券	6.2500	670	894	116,617	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国 債 証 券	0.0000	650	654	85,320	2023/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国 債 証 券	0.0000	800	806	105,126	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国 債 証 券	2.1000	350	469	61,196	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国 債 証 券	1.6500	450	473	61,744	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国 債 証 券	0.7500	480	495	64,647	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国 債 証 券	1.2000	640	670	87,454	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国 債 証 券	0.2500	140	128	16,772	2036/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国 債 証 券	1.7500	780	808	105,434	2023/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国 債 証 券	0.0000	300	254	33,233	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国 債 証 券	0.0000	190	186	24,248	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国 債 証 券	1.5000	150	165	21,628	2086/11/02
小 計	—	—	13,495	14,981	1,952,943	—
合 計	—	—	—	—	140,398,802	—

■投資信託財産の構成

2022年2月21日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
公 社 債	140,398,802		98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,603,315		1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	142,002,117		100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、141,683,656千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.06円、1カナダ・ドル=90.31円、1オーストラリア・ドル=82.72円、1シンガポール・ドル=85.55円、1イギリス・ポンド=156.56円、1イスラエル・シェケル=35.899円、1デンマーク・クローネ=17.53円、1ノルウェー・クローネ=12.83円、1スウェーデン・クローナ=12.24円、1メキシコ・ペソ=5.678円、1オフショア・人民元=18.197円、1マレーシア・リンギット=27.471円、1ポーランド・ズロチ=28.774円、1ユーロ=130.36円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	142,002,117,999円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	794,768,295
公 社 債(評価額)	140,398,802,240
未 収 利 息	769,298,727
前 払 費 用	39,248,737
(B) 負 債	37,199,000
未 払 解 約 金	37,199,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	141,964,918,999
元 本	70,448,298,510
次 期 繰 越 損 益 金	71,516,620,489
(D) 受 益 権 総 口 数	70,448,298,510口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	20,152円

(注1) 期首元本額	69,085,269,493円	DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	154,405,852円
追加設定元本額	27,244,251,872円	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	340,795,660円
一部解約元本額	25,881,222,855円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	412,429,256円
(注2) 期末における元本の内訳		9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	180,716,406円
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	7,932,936,286円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	87,293,544円
MITOラップ型ファンド(安定型)	10,339,634円	DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,181,097,770円
MITOラップ型ファンド(中立型)	40,206,625円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	515,001円
MITOラップ型ファンド(積極型)	116,655,366円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	358,315円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	57,288,539円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	100,794,148円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,587,798円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	418,167円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,681,845円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	546,045円
たわらノーロード 先進国債券	13,393,825,381円	インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定)	30,957,907円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	237,469,433円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型) 21-06	461,773,967円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,697,389,145円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	294,771円
たわらノーロード バランス (堅実型)	48,164,130円	DIAM海苔フルレンジ外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	5,739,805,045円
たわらノーロード バランス (標準型)	234,951,241円	DIAM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,636,710,982円
たわらノーロード バランス (積極型)	48,864,225円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,562,881,929円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	6,482,910円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,405,812,637円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	328,688,088円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	53,529,486円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	382,425,252円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	645,235円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	74,160,647円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	421,372,128円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	2,643,196円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	250,634,953円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	364,777円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	17,641,800円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,078,910円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	41,091,423円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	26,244,851円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	8,714,858円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,149,968円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	681,339円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,109,913円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	16,361,009円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,296,983,167円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	48,455,016円
One DC 先進国債券インデックスファンド	579,039,841円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,982,846,491円
Oneグローバルバランス	6,106,309円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,578,600,509円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	711,700,267円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,769,411,536円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,226,508,317円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	118,777,737円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,403,942,419円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	155,311,687円
DIAM DCバランス30インデックスファンド	398,546,899円	DIAMアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,842,758,601円
DIAM DCバランス50インデックスファンド	832,352,900円	DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	419,588,655円
DIAM DCバランス70インデックスファンド	708,824,350円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,247,697円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	14,028,565円	DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	357,842,695円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	469,729,710円	DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	352,697,590円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	33,691,463円	DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	479,890,739円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	134,924,668円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	57,398,790円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	124,156,154円	期末元本合計	70,448,298,510円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	214,713,670円		
フルーズコントロール	314,234,233円		

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,669,252,055	円
	受取利息	2,669,419,651	
	支払利息	△167,596	
(B)	有価証券売買損益	△631,639,253	
	売却益	7,707,170,489	
	売却損	△8,338,809,742	
(C)	その他の費用	△18,689,995	
(D)	当期損益金(A+B+C)	2,018,922,807	
(E)	前期繰越損益金	67,952,264,861	
(F)	解約差損益金	△26,936,052,307	
(G)	追加信託差損益金	28,481,485,128	
(H)	計(D+E+F+G)	71,516,620,489	
	次期繰越損益金(H)	71,516,620,489	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)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。

(注3) (G)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。