

運用報告書 (全体版)

第16期<決算日2024年10月15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・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
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、2024年10月15日に第16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

お客様の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

<https://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			
12期 (2020年10月12日)	円 16,904	円 0	% 5.3	ポイント 124,690.29	% 5.9	% 98.8	% -	百万円 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
15期 (2023年10月12日)	18,499	0	6.1	137,980.50	6.4	98.7	-	14,571
16期 (2024年10月15日)	20,164	0	9.0	151,107.04	9.5	98.5	-	15,722

(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 率
	円	騰 落 率	ポイ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2023 年 10 月 12 日	18,499	% —	ポイ ン ト 137,980.50	% —	% 98.7	% —
10 月 末	18,323	△1.0	136,724.14	△0.9	98.7	—
11 月 末	18,958	2.5	141,488.31	2.5	98.5	—
12 月 末	18,976	2.6	141,801.08	2.8	98.5	—
2024 年 1 月 末	19,308	4.4	144,118.59	4.4	99.4	—
2 月 末	19,550	5.7	146,060.66	5.9	98.4	—
3 月 末	19,788	7.0	148,025.68	7.3	98.3	—
4 月 末	20,156	9.0	150,600.10	9.1	98.5	—
5 月 末	20,263	9.5	151,556.11	9.8	98.7	—
6 月 末	20,958	13.3	156,909.67	13.7	98.8	—
7 月 末	20,194	9.2	150,966.61	9.4	98.6	—
8 月 末	19,676	6.4	147,107.78	6.6	98.3	—
9 月 末	19,717	6.6	147,442.45	6.9	99.1	—
(期 末) 2024 年 10 月 15 日	20,164	9.0	151,107.04	9.5	98.5	—

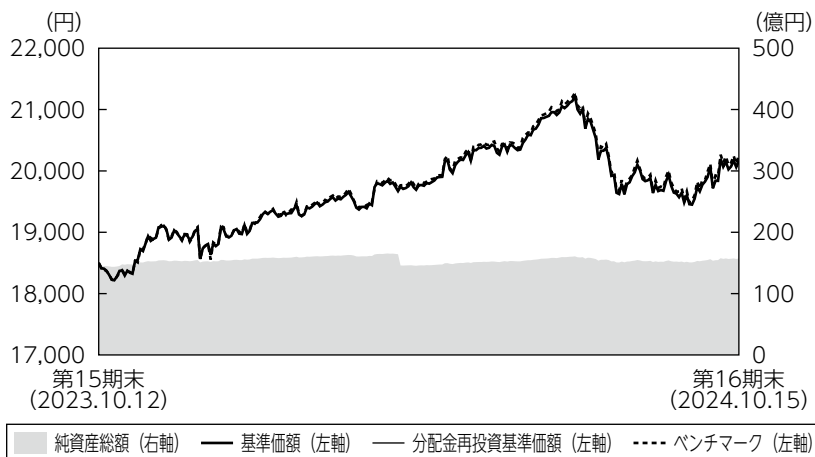
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2023年10月13日から2024年10月15日まで）

基準価額等の推移



第16期首：18,499円
第16期末：20,164円
(既払分配金0円)
騰落率：9.0%
(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す。
- (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

金融引き締め局面が終了し、各国中央銀行が利下げを開始したことを受けて、米国債、ドイツ国債の利回りは低下（価格は上昇）しました。米ドル/円は、2024年9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において、利下げが行われたものの、当期前半は米金利は高い水準で推移したこと、10月に発表された米雇用統計が堅調だったことを受けて、円安米ドル高になりました。債券の価格上昇、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低下する展開となりました。米国債は、米国のインフレの鈍化、米雇用者数の伸び鈍化や失業率の悪化などを受けて、F R B（米連邦準備理事会）が利下げのペースを早めるという観測から利回りは低下しました。ドイツ国債についてもヨーロッパの景気悪化懸念を受け、E C B（欧州中央銀行）が利下げを開始し利回りは低下しました。

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、政策金利を高水準で長期間維持したことで、日米の金利差が意識され円安に進みましたが、日銀による為替介入や2024年9月のF O M Cにおいて、0.5%の利下げが行われたことで円安の幅は縮小しました。

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。

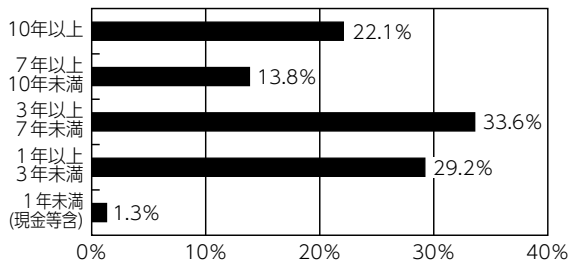
●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

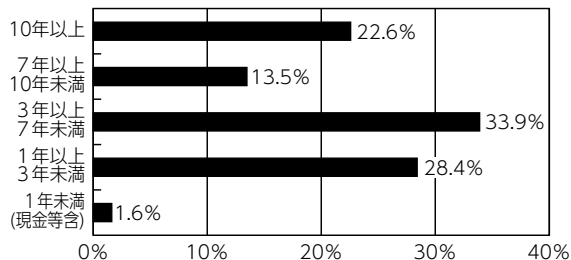
【運用状況】 ※比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

○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	47.8%	48.3%	△0.5%
	カナダ	2.0%	2.0%	0.0%
計		49.8%	50.2%	△0.5%
中南米	メキシコ	0.9%	0.9%	△0.0%
	計	0.9%	0.9%	△0.0%
欧州	オーストリア	1.2%	1.2%	0.0%
	ベルギー	1.8%	1.7%	0.1%
	フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
	フランス	8.3%	8.3%	△0.1%
	ドイツ	6.4%	6.4%	0.0%
	アイルランド	0.6%	0.6%	0.0%
	イタリア	7.3%	7.4%	△0.1%
	オランダ	1.4%	1.5%	△0.1%
	スペイン	4.8%	4.9%	△0.1%
	ユーロ計	32.3%	32.5%	△0.2%
	デンマーク	0.3%	0.3%	△0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	0.0%	
英国	4.9%	4.9%	0.0%	
ポーランド	0.5%	0.5%	△0.0%	
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%	
計	38.4%	38.6%	△0.2%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	1.4%	1.4%	0.0%
	ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
	中国	6.8%	7.4%	△0.6%
	シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
	マレーシア	0.5%	0.5%	△0.0%
計	9.4%	10.0%	△0.6%	
中東	イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
	計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など		1.3%	-	-
合計		100.0%	100.0%	-

期末

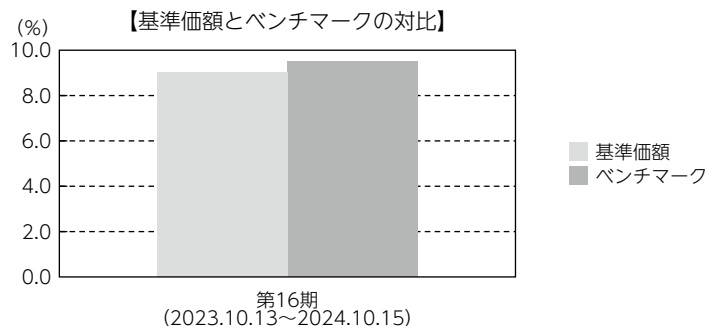
		ファンド	世界国債 インデックス	差
北米	米国	46.1%	46.7%	△0.6%
	カナダ	1.9%	1.9%	△0.0%
計		48.0%	48.6%	△0.7%
中南米	メキシコ	0.7%	0.8%	△0.0%
	計	0.7%	0.8%	△0.0%
欧州	オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
	ベルギー	1.6%	1.6%	△0.0%
	フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
	フランス	7.5%	7.6%	△0.1%
	ドイツ	5.9%	6.0%	△0.1%
	アイルランド	0.5%	0.5%	△0.0%
	イタリア	6.8%	6.9%	△0.1%
	オランダ	1.3%	1.3%	△0.0%
	スペイン	4.5%	4.5%	△0.1%
	ユーロ計	29.7%	30.1%	△0.4%
	デンマーク	0.3%	0.3%	△0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%	
英国	5.3%	5.4%	△0.1%	
ポーランド	0.5%	0.5%	△0.0%	
ノルウェー	0.1%	0.2%	△0.0%	
計	36.0%	36.6%	△0.6%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	1.3%	1.3%	△0.0%
	ニュージーランド	0.3%	0.3%	△0.0%
	中国	11.0%	11.3%	△0.2%
	シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
	マレーシア	0.5%	0.5%	△0.0%
計	13.5%	13.7%	△0.3%	
中東	イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
	計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など		1.5%	-	-
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9.5%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.5%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
	2023年10月13日 ～2024年10月15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	10,163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16期		項目の概要
	(2023年10月13日 ～2024年10月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	65円	0.333%	(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19,675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)	(55)	(0.277)	
(販売会社)	(4)	(0.022)	
(受託会社)	(7)	(0.033)	
(b) その他費用	4	0.022	(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)	(3)	(0.017)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	70	0.354	

(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。

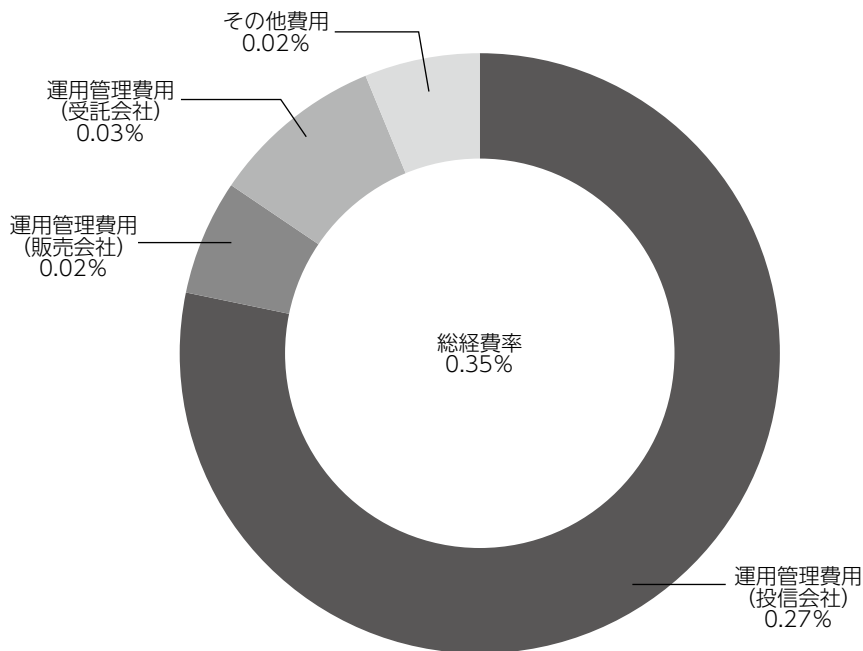
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2023年10月13日から2024年10月15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□ 820,456	千円 1,910,668	千□ 908,703	千円 2,129,091

■利害関係人との取引状況等（2023年10月13日から2024年10月15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

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□ 6,618,987	千□ 6,530,740	千円 15,722,105

■投資信託財産の構成

2024年10月15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	15,722,105	99.6
コール・ローン等、その他	59,500	0.4
投資信託財産総額	15,781,605	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、2024年10月15日現在、269,811,439千円、97.5%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、2024年10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.67円、1カナダ・ドル=108.49円、1オーストラリア・ドル=100.67円、1シンガポール・ドル=114.47円、1ニュージーランド・ドル=91.16円、1イギリス・ポンド=195.57円、1イスラエル・シケル=39.731円、1デンマーク・クローネ=21.88円、1ノルウェー・クローネ=13.86円、1スウェーデン・クローナ=14.36円、1メキシコ・ペソ=7.704円、1オフショア・人民元=21.093円、1マレーシア・リングギット=34.816円、1ポーランド・ズロチ=38.019円、1ユーロ=163.25円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年10月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	15,781,605,727円
コール・ローン等	57,832,648
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	15,722,105,079
未 収 入 金	1,668,000
(B) 負 債	58,670,583
未 払 解 約 金	32,706,287
未 払 信 託 報 酬	25,682,736
そ の 他 未 払 費 用	281,560
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	15,722,935,144
元 本	7,797,683,883
次 期 繰 越 損 益 金	7,925,251,261
(D) 受 益 権 総 口 数	7,797,683,883口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	20,164円

(注) 期首における元本額は7,876,825,839円、当期中における追加設定元本額は1,427,659,999円、同解約元本額は1,506,801,955円です。

■損益の状況

当期 自2023年10月13日 至2024年10月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	21,602円
受 取 利 息	22,742
支 払 利 息	△1,140
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,204,616,593
売 買 益	1,368,255,085
売 買 損	△163,638,492
(C) 信 託 報 酬 等	△51,908,984
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,152,729,211
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,530,447,118
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,242,074,932
(配 当 等 相 当 額)	(4,772,643,792)
(売 買 損 益 相 当 額)	(469,431,140)
(G) 合 計(D+E+F)	7,925,251,261
次 期 繰 越 損 益 金(G)	7,925,251,261
追 加 信 託 差 損 益 金	5,242,074,932
(配 当 等 相 当 額)	(4,774,543,838)
(売 買 損 益 相 当 額)	(467,531,094)
分 配 準 備 積 立 金	2,683,176,329

(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	371,849,630円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	780,879,581
(c) 収 益 調 整 金	5,242,074,932
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,530,447,118
(e) 当 期 配 分 対 象 額(a+b+c+d)	7,925,251,261
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 配 分 対 象 額	10,163.60
(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21期（決算日 2024年2月21日）

（計算期間 2023年2月22日～2024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21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	債券先物率	純資産額
	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率			
17期 (2020年2月21日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
20期 (2023年2月21日)	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964
21期 (2024年2月21日)	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-	186,822
	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	-	260,393

(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）。

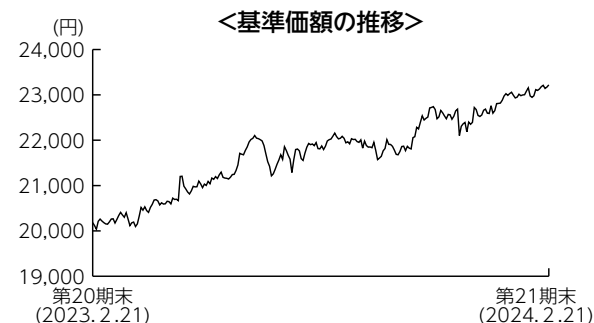
■当期中の基準価額と市況の推移

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 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023 年 2 月 21 日	円 20,182	% -	ポイント 126,494.96	% -	% 99.0	% -
2 月 末	20,261	0.4	126,903.56	0.3	98.9	-
3 月 末	20,517	1.7	128,532.24	1.6	98.7	-
4 月 末	20,668	2.4	129,370.99	2.3	98.6	-
5 月 末	21,198	5.0	132,828.99	5.0	98.8	-
6 月 末	22,045	9.2	138,284.08	9.3	98.7	-
7 月 末	21,569	6.9	135,227.94	6.9	98.7	-
8 月 末	22,157	9.8	138,880.03	9.8	98.9	-
9 月 末	21,834	8.2	136,810.50	8.2	98.6	-
10 月 末	21,807	8.1	136,724.14	8.1	98.7	-
11 月 末	22,569	11.8	141,488.31	11.9	98.5	-
12 月 末	22,596	12.0	141,801.08	12.1	98.5	-
2024 年 1 月 末	22,998	14.0	144,118.59	13.9	99.4	-
(期 末) 2024 年 2 月 21 日	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	-

(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（2023年2月22日から2024年2月21日まで）

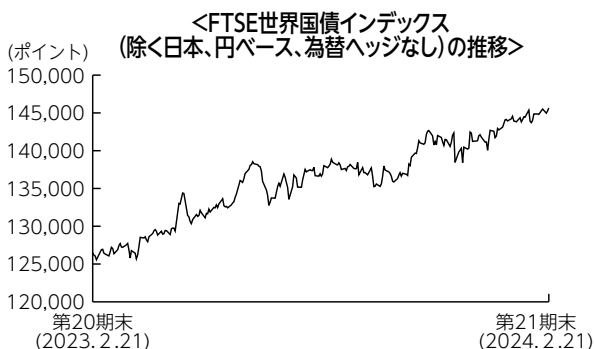


基準価額の推移

当期末の基準価額は23,220円となり、前期末比で15.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは、上昇（価格は下落）しました。米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下（価格は上昇）したのち、金融引き締め長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドル／円については日銀が金融緩和を継続する中、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを継続したことを受け、日米金利差が意識され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、米国債利回りは上昇、ドイツ債の利回りは低下しました。米国債は、米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下したのち、金融引き締め長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドイツ債については、金融引き締め長期化観測が高まり上昇したのちに、ユーロ圏の景気懸念やインフレの鈍化などから利回りは低下しました。

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 R Bが金融引き締めを継続する中、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

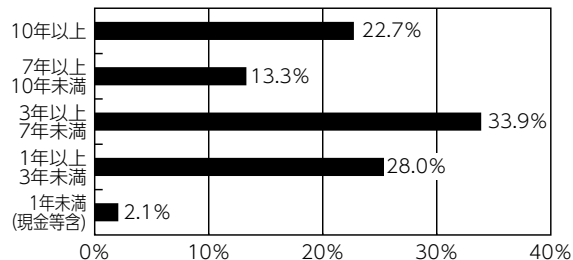
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

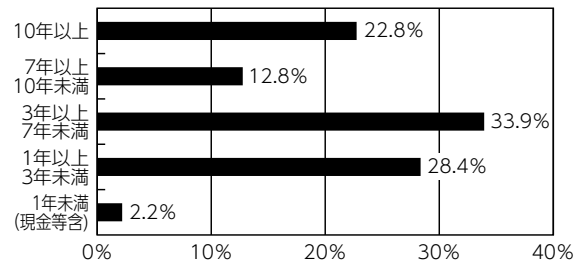
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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	49.5%	50.0%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.1%	△0.0%
計	51.6%	52.0%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.9%	0.9%	△0.0%
計	0.9%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.9%	1.9%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.4%	8.4%	0.0%
ドイツ	6.5%	6.4%	0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.5%	7.6%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	5.0%	5.0%	△0.0%
ユーロ計	33.1%	33.2%	△0.1%
デンマーク	0.3%	0.3%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
英国	4.8%	4.7%	0.1%
ポーランド	0.4%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	39.0%	39.1%	△0.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.6%	1.6%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	4.4%	4.8%	△0.4%
シンガポール	0.5%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.6%	△0.0%
計	7.2%	7.6%	△0.4%
中近東			
イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など	1.0%	-	-
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	46.7%	47.2%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	48.7%	49.2%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.9%	△0.0%
計	0.8%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.7%	1.8%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.0%	8.1%	△0.1%
ドイツ	6.3%	6.3%	△0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.3%	7.3%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	4.8%	4.9%	△0.1%
ユーロ計	31.8%	32.1%	△0.3%
デンマーク	0.3%	0.3%	△0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
英国	5.2%	5.2%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	38.1%	38.5%	△0.4%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.3%	1.4%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	8.3%	8.5%	△0.2%
シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	△0.0%
計	10.7%	11.0%	△0.3%
中近東			
イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
計	0.3%	0.3%	△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15.1%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークと同程度となり、概ねベンチマークに連動した結果となりました。

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 (保 管 費 用)	3円	0.015%	(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
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	3	0.015	
期中の平均基準価額は21,728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 (2023年2月22日から2024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 459,048	千アメリカ・ドル 331,987	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 25,463	千カナダ・ドル 17,904	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 16,897	千オーストラリア・ドル 13,157	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 3,224	千シンガポール・ドル 2,464	
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 2,597	千ニュージーランド・ドル 989	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 40,138	千イギリス・ポンド 22,621	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 7,410	千イスラエル・シケル 3,549	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 11,286	千デンマーク・クローネ 12,347	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 13,227	千ノルウェー・クローネ 10,083	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 9,524	千スウェーデン・クローナ 2,541	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 113,030	千メキシコ・ペソ 81,670	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 730,187	千オフショア・人民元 137,577	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 11,910	千マレーシア・リンギット 7,301	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 16,614	千ポーランド・ズロチ 10,609	
国	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
		アイルランド	国債証券	3,525	2,887
		オランダ	国債証券	11,284	8,015
		ベルギー	国債証券	12,412	9,503
		フランス	国債証券	70,879	54,149
		ドイツ	国債証券	54,900	40,085
		スペイン	国債証券	40,842	30,090
		イタリア	国債証券	62,054	47,199
	フィンランド	国債証券	3,929	2,451	
	オーストリア	国債証券	10,493	7,197	

(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 (2023年2月22日から2024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 916,450	千アメリカ・ドル 810,479	千円 121,701,636	% 46.7	% -	% 19.6	% 19.4	% 7.8	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 50,260	千カナダ・ドル 46,076	千円 5,115,401	2.0	-	1.1	0.5	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 40,065	千オーストラリア・ドル 35,489	千円 3,492,489	1.3	-	0.9	0.3	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 9,855	千シンガポール・ドル 9,323	千円 1,041,728	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 7,570	千ニュージーランド・ドル 6,419	千円 594,617	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 86,324	千イギリス・ポンド 70,878	千円 13,437,202	5.2	-	3.5	1.1	0.6	
イスラエル	千イスラエル・シケル 22,320	千イスラエル・シケル 19,889	千円 810,730	0.3	-	0.2	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 32,720	千デンマーク・クローネ 30,676	千円 668,129	0.3	-	0.2	0.0	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32,620	千ノルウェー・クローネ 29,940	千円 429,040	0.2	-	0.1	0.0	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 37,140	千スウェーデン・クローナ 35,693	千円 517,914	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 273,005	千メキシコ・ペソ 250,053	千円 2,201,447	0.8	-	0.5	0.3	0.0	
中 国	千オフショア・人民元 1,000,520	千オフショア・人民元 1,032,940	千円 21,528,239	8.3	-	3.7	3.7	0.8	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 38,060	千マレーシア・リンギット 38,987	千円 1,219,734	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 39,150	千ポーランド・ズロチ 35,744	千円 1,344,336	0.5	-	0.2	0.3	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	10,200	9,105	1,478,204	0.6	-	0.4	0.1	0.0	
オランダ	25,700	23,264	3,776,775	1.5	-	0.8	0.5	0.1	
ベルギー	30,390	27,580	4,477,411	1.7	-	1.2	0.5	0.1	
フランス	141,120	128,977	20,938,250	8.0	-	4.8	2.6	0.6	
ドイツ	108,580	100,614	16,333,748	6.3	-	3.3	2.1	0.8	
スペイン	82,390	77,154	12,525,285	4.8	-	2.7	1.6	0.6	
イタリア	122,640	116,425	18,900,577	7.3	-	4.1	2.5	0.7	
フィンランド	9,630	8,170	1,326,408	0.5	-	0.3	0.1	0.1	
オーストリア	21,230	18,965	3,078,798	1.2	-	0.6	0.5	0.1	
合 計	-	-	千円 256,938,107	98.7	-	48.9	36.6	13.1	

(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	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	
(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	2,460	2,371	356,089	2026/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	5,740	5,288	794,126	2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	4,000	600,691	2029/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	725	108,912	2025/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,819	573,587	2028/01/31
US T N/B 4.125 01/31/25	国債証券	4.1250	1,800	1,785	268,146	2025/01/31
US T N/B 3.5 01/31/30	国債証券	3.5000	3,400	3,261	489,813	2030/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	5,700	5,256	789,361	2026/01/31
US T N/B 3.5 01/31/28	国債証券	3.5000	2,380	2,310	346,875	2028/01/31
US T N/B 4.0 01/15/27	国債証券	4.0000	3,000	2,968	445,728	2027/01/15
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	4,300	4,243	637,175	2026/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	2,400	2,464	370,083	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,360	1,120	168,216	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,540	1,255	188,501	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,370	973	146,217	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	1,000	903	135,633	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,860	1,992	299,197	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	500	515	77,347	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,230	1,267	190,255	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,424	213,888	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	4,610	3,530	530,129	2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	5,000	3,219	483,415	2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	603	90,611	2038/02/15
US T N/B 3.625 02/15/53	国債証券	3.6250	3,800	3,277	492,149	2053/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	1,690	1,723	258,845	2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,636	395,854	2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	5,780	3,405	511,431	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	6,090	5,751	863,678	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,810	2,020	303,350	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	2,360	1,825	274,185	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,037	306,020	2048/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,981	297,545	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,830	4,477	672,407	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,540	4,283	643,206	2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,556	534,113	2027/02/15
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,189	328,837	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,917	287,912	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	9,690	7,896	1,185,695	2031/02/15
US T N/B 3.875 02/15/43	国債証券	3.8750	3,500	3,186	478,547	2043/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	5,100	3,485	523,327	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	4,420	2,712	407,376	2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	8,280	6,939	1,041,964	2032/02/15
US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	3.5000	7,900	7,436	1,116,617	2033/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,000	150,171	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	4,830	4,128	619,966	2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	5,210	4,844	727,417	2027/02/28
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,867	430,577	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	4,690	4,143	622,257	2028/02/29

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 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750	4,700	4,196	630,186	2029/02/28	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	5,170	4,766	715,767	2026/02/28	
US T N/B 1.5 02/15/25	国債証券	1.5000	4,550	4,397	660,307	2025/02/15	
US T N/B 4.0 02/28/30	国債証券	4.0000	3,000	2,955	443,775	2030/02/28	
US T N/B 4.0 02/29/28	国債証券	4.0000	3,200	3,163	474,993	2028/02/29	
US T N/B 4.0 02/15/26	国債証券	4.0000	4,000	3,956	594,070	2026/02/15	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	1,790	1,746	262,297	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	3,300	3,150	473,093	2026/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	3,200	2,856	428,894	2027/03/31	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	2,860	2,726	409,343	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	4,610	4,084	613,360	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	5,720	5,290	794,463	2026/03/31	
US T N/B 2.375 03/31/29	国債証券	2.3750	4,000	3,655	548,928	2029/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	4,000	3,786	568,508	2027/03/31	
US T N/B 3.625 03/31/30	国債証券	3.6250	3,300	3,183	478,087	2030/03/31	
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	4,000	3,868	580,908	2025/03/15	
US T N/B 3.625 03/31/28	国債証券	3.6250	3,800	3,703	556,131	2028/03/31	
US T N/B 4.625 03/15/26	国債証券	4.6250	3,630	3,634	545,751	2026/03/15	
US T N/B 3.875 03/31/25	国債証券	3.8750	1,050	1,038	155,949	2025/03/31	
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	2,000	1,954	293,521	2025/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	2,060	1,968	295,603	2026/04/30	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	5,100	4,508	677,014	2028/04/30	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,370	2,100	315,397	2027/04/30	
US T N/B 2.875 04/30/29	国債証券	2.8750	3,800	3,555	533,875	2029/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	6,000	5,533	830,889	2026/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/28	国債証券	3.5000	3,100	3,005	451,331	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,560	2,428	364,723	2025/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	6,000	5,713	857,953	2027/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/30	国債証券	3.5000	3,000	2,873	431,413	2030/04/30	
US T N/B 3.75 04/15/26	国債証券	3.7500	6,000	5,904	886,600	2026/04/15	
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	3,000	2,925	439,288	2025/04/15	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	759	839	126,116	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,210	1,197	179,777	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,630	1,601	240,549	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	1,080	869	130,615	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	950	933	140,155	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,290	1,790	268,860	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	5,560	3,696	555,136	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,430	1,201	180,401	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,290	1,011	151,893	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,620	1,251	187,879	2047/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/52	国債証券	2.8750	4,510	3,346	502,453	2052/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,730	1,226	184,132	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,830	2,224	334,027	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,300	2,015	302,659	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	4,600	3,435	515,839	2049/05/15	
US T N/B 3.625 05/15/53	国債証券	3.6250	3,510	3,029	454,981	2053/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	600	609	91,556	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	4,420	3,201	480,734	2041/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,950	3,823	574,086	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,860	4,594	689,924	2028/05/15	

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 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	3,770	3,439	516,436	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,430	4,166	625,673	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	755	810	121,723	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	5,170	4,856	729,232	2026/05/15
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	8,380	4,185	628,531	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,250	2,135	320,676	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	8,740	7,316	1,098,697	2031/05/15
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	1,570	1,532	230,147	2025/05/31
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	3,760	3,143	472,092	2042/05/15
US T N/B 3.875 05/15/43	国債証券	3.8750	800	728	109,316	2043/05/15
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	8,050	7,264	1,090,860	2032/05/15
US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	3.3750	7,500	6,979	1,048,025	2033/05/15
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	2,980	2,632	395,230	2027/05/31
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,140	3,652	548,447	2028/05/31
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	7,050	5,653	848,990	2030/05/15
US T N/B 2.625 05/31/27	国債証券	2.6250	4,910	4,651	698,405	2027/05/31
US T N/B 2.75 05/31/29	国債証券	2.7500	3,300	3,065	460,240	2029/05/31
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	5,630	5,177	777,521	2026/05/31
US T N/B 3.625 05/31/28	国債証券	3.6250	2,500	2,435	365,721	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	1,690	1,595	239,555	2025/05/31
US T N/B 3.75 05/31/30	国債証券	3.7500	3,500	3,397	510,121	2030/05/31
US T N/B 3.625 05/15/26	国債証券	3.6250	3,500	3,434	515,746	2026/05/15
US T N/B 2.75 05/15/25	国債証券	2.7500	2,200	2,145	322,144	2025/05/15
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,040	1,012	152,073	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	2,880	2,715	407,729	2026/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	2,780	2,448	367,718	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,710	3,265	490,340	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,500	3,293	494,529	2025/06/30
US T N/B 3.25 06/30/27	国債証券	3.2500	4,200	4,057	609,214	2027/06/30
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	4,510	4,152	623,586	2026/06/30
US T N/B 3.25 06/30/29	国債証券	3.2500	3,500	3,329	500,000	2029/06/30
US T N/B 2.875 06/15/25	国債証券	2.8750	2,420	2,361	354,536	2025/06/15
US T N/B 4.0 06/30/28	国債証券	4.0000	2,000	1,977	296,906	2028/06/30
US T N/B 4.125 06/15/26	国債証券	4.1250	4,700	4,661	700,031	2026/06/15
US T N/B 3.75 06/30/30	国債証券	3.7500	5,700	5,531	830,535	2030/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	2,200	2,143	321,828	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,500	2,352	353,183	2026/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	9,270	8,049	1,208,687	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,780	3,304	496,221	2027/07/31
US T N/B 4.0 07/31/30	国債証券	4.0000	2,500	2,459	369,343	2030/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	3,800	3,563	535,067	2025/07/31
US T N/B 2.625 07/31/29	国債証券	2.6250	3,070	2,827	424,508	2029/07/31
US T N/B 4.125 07/31/28	国債証券	4.1250	2,500	2,484	373,061	2028/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	5,100	4,651	698,507	2026/07/31
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	3,820	3,625	544,426	2027/07/31
US T N/B 3.0 07/15/25	国債証券	3.0000	3,200	3,124	469,137	2025/07/15
US T N/B 4.5 07/15/26	国債証券	4.5000	4,100	4,102	615,956	2026/07/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	1,220	1,105	165,966	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,290	1,198	179,897	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,240	957	143,852	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,090	1,684	252,930	2044/08/15

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 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	1,480	1,492	224,181	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,470	1,287	193,397	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,810	3,522	528,927	2051/08/15
US T N/B 4.125 08/15/53	国債証券	4.1250	1,600	1,512	227,173	2053/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,355	203,495	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	3,550	3,411	512,338	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,640	246,263	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	4,140	2,705	406,314	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	5,540	4,220	633,695	2052/08/15
US T N/B 4.375 08/15/43	国債証券	4.3750	2,000	1,948	292,647	2043/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,270	1,526	229,150	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,810	2,922	438,881	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,955	593,938	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	7,030	6,545	982,844	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	5,030	4,742	712,199	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,777	266,844	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,360	2,938	441,214	2029/08/15
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,482	372,739	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	5,310	3,510	527,153	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	4,060	2,456	368,814	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	6,870	3,546	532,522	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	7,840	6,984	1,048,768	2032/08/15
US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	3.8750	8,000	7,742	1,162,613	2033/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,960	7,241	1,087,383	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	7,740	6,153	923,979	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	2,800	2,596	389,899	2026/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,354	503,781	2025/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,249	488,017	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,680	402,439	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	4,950	4,517	678,384	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,960	444,578	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,935	440,838	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,783	568,138	2027/08/31
US T N/B 4.375 08/15/26	国債証券	4.3750	4,000	3,991	599,431	2026/08/15
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,703	255,861	2025/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,810	3,312	497,388	2027/09/30
US T N/B 4.625 09/30/30	国債証券	4.6250	3,000	3,057	459,067	2030/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,444	216,919	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	4,980	4,354	653,898	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,465	520,399	2025/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	3,220	3,197	480,106	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	5,510	5,036	756,246	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,944	442,183	2025/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	4,550	4,459	669,563	2029/09/30
US T N/B 4.625 09/15/26	国債証券	4.6250	3,500	3,514	527,756	2026/09/15
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	2,270	2,208	331,602	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,410	2,240	336,454	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,134	620,794	2028/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,187	478,590	2027/10/31
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	4,490	4,118	618,411	2026/10/31
US T N/B 4.0 10/31/29	国債証券	4.0000	2,700	2,662	399,730	2029/10/31

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 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	3,340	3,315	497,919	2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	4,000	3,714	557,809	2025/10/31
US T N/B 4.625 10/15/26	国債証券	4.6250	3,400	3,415	512,877	2026/10/15
US T N/B 4.25 10/15/25	国債証券	4.2500	4,000	3,972	596,451	2025/10/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,350	1,406	211,165	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,200	2,334	350,598	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,960	1,543	231,777	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	1,300	1,261	189,496	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,556	1,197	179,882	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,020	843	126,592	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,460	1,300	195,336	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,250	1,652	248,089	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	5,280	2,917	438,077	2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	5,370	3,146	472,444	2051/11/15
US T N/B 4.0 11/15/52	国債証券	4.0000	4,860	4,492	674,588	2052/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	460	359	53,947	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	1,080	818	122,902	2046/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,000	992	149,086	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,450	2,834	425,581	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	3,690	2,478	372,127	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,120	4,916	738,276	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	5,480	5,213	782,857	2028/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	7,830	7,347	1,103,278	2026/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,038	456,239	2027/11/15
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	3,360	3,259	489,371	2025/11/30
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	3,120	2,895	434,789	2042/11/15
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	4,320	2,717	408,105	2040/11/15
US T N/B 4.75 11/15/43	国債証券	4.7500	500	512	76,927	2043/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	4,250	2,923	438,985	2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,680	252,318	2026/11/30
US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	4.1250	7,600	7,507	1,127,285	2032/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,850	2,497	375,063	2029/11/15
US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	4.5000	2,000	2,033	305,294	2033/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	8,590	6,959	1,044,999	2031/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	9,480	7,624	1,144,902	2030/11/15
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	3,900	3,403	511,082	2027/11/30
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	4,700	4,317	648,244	2026/11/30
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	5,000	4,406	661,701	2028/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	5,190	4,815	723,118	2025/11/30
US T N/B 3.875 11/30/29	国債証券	3.8750	2,800	2,742	411,825	2029/11/30
US T N/B 3.875 11/30/27	国債証券	3.8750	3,300	3,248	487,727	2027/11/30
US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	4.5000	3,570	3,559	534,542	2025/11/15
US T N/B 4.625 11/15/26	国債証券	4.6250	3,900	3,919	588,620	2026/11/15
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	3,000	2,894	434,704	2025/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	2,110	1,962	294,640	2026/12/31
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	3,890	3,566	535,578	2026/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,600	4,022	603,948	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	4,000	3,701	555,861	2025/12/31
US T N/B 3.875 12/31/29	国債証券	3.8750	2,800	2,741	411,628	2029/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	4,020	3,497	525,216	2027/12/31
US T N/B 4.375 12/15/26	国債証券	4.3750	4,800	4,796	720,289	2026/12/15

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 4.0 12/15/25		国債証券	4.0000	4,140	4,093	614,692	2025/12/15
US T N/B 3.875 12/31/27		国債証券	3.8750	4,600	4,527	679,794	2027/12/31
小計		—	—	916,450	810,479	121,701,636	—
(カナダ)			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 3.75 02/01/25		国債証券	3.7500	1,160	1,150	127,675	2025/02/01
CANADA 1.25 03/01/25		国債証券	1.2500	700	676	75,148	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26		国債証券	0.2500	1,410	1,306	145,062	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27		国債証券	1.2500	910	844	93,769	2027/03/01
CANADA 3.5 03/01/28		国債証券	3.5000	1,630	1,619	179,792	2028/03/01
CANADA 3.0 04/01/26		国債証券	3.0000	1,400	1,370	152,122	2026/04/01
CANADA 1.5 04/01/25		国債証券	1.5000	1,100	1,063	118,083	2025/04/01
CANADA 1.5 06/01/26		国債証券	1.5000	1,700	1,608	178,594	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29		国債証券	5.7500	740	818	90,862	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33		国債証券	5.7500	610	716	79,595	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37		国債証券	5.0000	630	728	80,894	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41		国債証券	4.0000	740	790	87,730	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28		国債証券	2.0000	930	871	96,783	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25		国債証券	2.2500	1,320	1,283	142,538	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27		国債証券	1.0000	550	504	56,015	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29		国債証券	2.2500	530	498	55,311	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30		国債証券	1.2500	2,350	2,051	227,786	2030/06/01
CANADA 2.75 06/01/33		国債証券	2.7500	1,180	1,109	123,221	2033/06/01
CANADA 1.5 06/01/31		国債証券	1.5000	2,470	2,151	238,845	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32		国債証券	2.0000	1,590	1,417	157,375	2032/06/01
CANADA 3.5 08/01/25		国債証券	3.5000	400	394	43,835	2025/08/01
CANADA 0.5 09/01/25		国債証券	0.5000	2,310	2,180	242,092	2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27		国債証券	2.7500	1,050	1,015	112,775	2027/09/01
CANADA 1.0 09/01/26		国債証券	1.0000	2,670	2,484	275,819	2026/09/01
CANADA 3.25 09/01/28		国債証券	3.2500	1,200	1,181	131,149	2028/09/01
CANADA 3.0 10/01/25		国債証券	3.0000	1,660	1,625	180,456	2025/10/01
CANADA 3.5 12/01/45		国債証券	3.5000	800	806	89,588	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48		国債証券	2.7500	850	756	83,977	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51		国債証券	2.0000	3,460	2,590	287,617	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53		国債証券	1.7500	2,180	1,515	168,246	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64		国債証券	2.7500	390	339	37,706	2064/12/01
CANADA 2.75 12/01/55		国債証券	2.7500	300	263	29,268	2055/12/01
CANADA 3.25 12/01/33		国債証券	3.2500	2,100	2,056	228,316	2033/12/01
CANADA 0.5 12/01/30		国債証券	0.5000	2,600	2,132	236,789	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31		国債証券	1.5000	2,420	2,089	231,956	2031/12/01
CANADA 2.5 12/01/32		国債証券	2.5000	1,520	1,403	155,853	2032/12/01
CANADA 2.25 12/01/29		国債証券	2.2500	700	655	72,741	2029/12/01
小計		—	—	50,260	46,076	5,115,401	—
(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	1,090	849	83,589	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25		国債証券	3.2500	1,100	1,090	107,360	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27		国債証券	4.7500	1,540	1,585	156,040	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26		国債証券	4.2500	1,600	1,615	158,958	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29		国債証券	3.2500	1,400	1,362	134,035	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33		国債証券	4.5000	1,660	1,702	167,580	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37		国債証券	3.7500	830	783	77,150	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28		国債証券	2.2500	1,780	1,674	164,777	2028/05/21

銘	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	
(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 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,660	1,529	150,519	2030/05/21	
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	960	762	75,080	2041/05/21	
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	2,130	1,706	167,951	2032/05/21	
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	1,800	1,734	170,694	2034/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	820	716	70,462	2039/06/21	
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	2,010	1,689	166,222	2031/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	650	563	55,483	2035/06/21	
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	2,520	1,420	139,792	2051/06/21	
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	2,615	2,408	237,000	2026/09/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	450	429	42,287	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,430	1,380	135,820	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,400	1,319	129,819	2029/11/21	
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	1,670	1,513	148,951	2033/11/21	
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	1,850	1,527	150,297	2032/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	2,470	1,969	193,799	2031/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,460	1,372	135,065	2025/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,670	1,374	135,234	2030/12/21	
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	1,500	1,407	138,513	2034/12/21	
小計	—	—	40,065	35,489	3,492,489	—	
(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 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	800	810	90,501	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	460	441	49,339	2046/03/01	
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	840	672	75,082	2050/03/01	
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	660	636	71,104	2042/04/01	
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	340	334	37,399	2028/05/01	
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	780	769	85,999	2025/06/01	
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	590	576	64,404	2026/06/01	
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	640	635	70,970	2029/07/01	
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	190	174	19,487	2039/07/01	
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	840	760	84,946	2031/07/01	
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国債証券	3.0000	125	127	14,224	2072/08/01	
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	890	816	91,260	2036/08/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	620	613	68,510	2030/09/01	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	580	594	66,424	2033/09/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国債証券	2.8750	200	198	22,223	2027/09/01	
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	510	409	45,725	2051/10/01	
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500	510	485	54,281	2026/11/01	
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	280	267	29,842	2025/11/01	
小計	—	—	9,855	9,323	1,041,728	—	
(ニュージーランド)			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	800	793	73,529	2027/04/15	
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	450	406	37,662	2033/04/14	
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	810	635	58,902	2037/04/15	
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	670	650	60,235	2025/04/15	
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	750	693	64,206	2029/04/20	
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	540	355	32,892	2051/05/15	
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	400	247	22,932	2041/05/15	
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	880	706	65,439	2031/05/15	
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	130	123	11,456	2034/05/15	
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	910	739	68,519	2032/05/15	
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	650	540	50,074	2028/05/15	

銘	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	
(ニュージーランド)			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26		国債証券	0.5000	580	526	48,766	2026/05/15
小計		-	-	7,570	6,419	594,617	-
(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	1,640	1,356	257,233	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45		国債証券	3.5000	1,550	1,324	251,087	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60		国債証券	4.0000	900	816	154,822	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49		国債証券	1.7500	1,130	658	124,799	2049/01/22
UK TREASURY 3.75 01/29/38		国債証券	3.7500	1,650	1,543	292,668	2038/01/29
UK TREASURY 0.875 01/31/46		国債証券	0.8750	1,350	664	125,901	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39		国債証券	1.1250	2,110	1,354	256,764	2039/01/31
UK TREASURY 4.625 01/31/34		国債証券	4.6250	400	416	78,930	2034/01/31
UK TREASURY 1.0 01/31/32		国債証券	1.0000	2,470	1,970	373,512	2032/01/31
UK TREASURY 3.25 01/31/33		国債証券	3.2500	2,500	2,351	445,707	2033/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29		国債証券	0.5000	1,880	1,590	301,513	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28		国債証券	0.1250	1,340	1,152	218,484	2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25		国債証券	0.2500	1,700	1,630	309,123	2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26		国債証券	0.1250	1,750	1,617	306,579	2026/01/30
UK TREASURY 4.125 01/29/27		国債証券	4.1250	2,340	2,334	442,643	2027/01/29
UK TREASURY 5.0 03/07/25		国債証券	5.0000	1,485	1,488	282,244	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36		国債証券	4.2500	1,300	1,302	246,995	2036/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32		国債証券	4.2500	1,770	1,804	342,006	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25		国債証券	0.6250	1,060	1,008	191,181	2025/06/07
UK TREASURY 4.5 06/07/28		国債証券	4.5000	1,750	1,779	337,300	2028/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47		国債証券	1.5000	1,200	671	127,395	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51		国債証券	1.2500	1,730	839	159,095	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52		国債証券	3.7500	970	841	159,613	2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53		国債証券	1.5000	1,210	612	116,163	2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57		国債証券	1.7500	1,260	664	125,977	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65		国債証券	2.5000	1,250	790	149,810	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68		国債証券	3.5000	1,480	1,209	229,224	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26		国債証券	1.5000	1,900	1,785	338,431	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27		国債証券	1.2500	1,100	1,002	190,046	2027/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33		国債証券	0.8750	2,100	1,577	299,050	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31		国債証券	0.2500	2,240	1,707	323,797	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35		国債証券	0.6250	1,650	1,119	212,208	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39		国債証券	4.2500	1,060	1,037	196,777	2039/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25		国債証券	2.0000	1,110	1,069	202,679	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34		国債証券	4.5000	1,200	1,235	234,298	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37		国債証券	1.7500	1,890	1,394	264,361	2037/09/07
UK TREASURY 3.75 10/22/53		国債証券	3.7500	1,800	1,553	294,531	2053/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/54		国債証券	1.6250	1,270	659	124,953	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61		国債証券	0.5000	1,880	553	105,010	2061/10/22
UK TREASURY 4.0 10/22/63		国債証券	4.0000	820	741	140,616	2063/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71		国債証券	1.6250	830	380	72,117	2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73		国債証券	1.1250	740	267	50,729	2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41		国債証券	1.2500	1,750	1,062	201,452	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50		国債証券	0.6250	1,640	653	123,948	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28		国債証券	1.6250	1,030	929	176,235	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29		国債証券	0.8750	1,430	1,211	229,594	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30		国債証券	0.3750	1,390	1,103	209,195	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26		国債証券	0.3750	2,430	2,199	417,048	2026/10/22

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	
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	国債証券	3.5000	1,500	1,475	279,692	2025/10/22	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	980	1,066	202,208	2028/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	1,380	1,433	271,745	2038/12/07	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,745	1,738	329,574	2042/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,280	1,217	230,757	2046/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,112	1,051	199,340	2055/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	1,310	1,318	249,993	2027/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,770	1,722	326,463	2040/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,495	1,566	297,060	2030/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	1,317	1,247	236,498	2049/12/07	
小計	—	—	86,324	70,878	13,437,202	—	
(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	1,410	1,557	63,474	2042/01/31	
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国債証券	0.5000	1,430	1,340	54,621	2026/02/27	
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,810	1,561	63,652	2047/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	1,660	1,573	64,133	2027/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	2,860	2,401	97,869	2030/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	国債証券	1.3000	2,300	1,845	75,210	2032/04/30	
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	1,890	1,819	74,162	2025/04/30	
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	2,420	1,697	69,175	2037/05/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,000	1,941	79,122	2025/08/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	2,360	2,199	89,634	2028/09/28	
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	1,220	1,294	52,768	2026/10/30	
ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	国債証券	2.8000	960	660	26,904	2052/11/29	
小計	—	—	22,320	19,889	810,730	—	
(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	4,560	2,443	53,218	2052/11/15	
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	7,650	9,509	207,116	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	3,740	3,675	80,049	2025/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	4,850	4,516	98,367	2027/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	5,140	4,627	100,786	2029/11/15	
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	5,080	4,236	92,261	2031/11/15	
DENMARK 2.25 11/15/33	国債証券	2.2500	1,700	1,667	36,328	2033/11/15	
小計	—	—	32,720	30,676	668,129	—	
(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	6,710	6,386	91,511	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	5,100	4,792	68,683	2027/02/17	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	1,130	1,099	15,759	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	1,924	27,576	2028/04/26	
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	2,030	1,788	25,630	2032/05/18	
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	4,610	3,978	57,006	2030/08/19	
NORWAY 3.0 08/15/33	国債証券	3.0000	2,900	2,715	38,916	2033/08/15	
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	2,920	2,627	37,652	2029/09/06	
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,950	2,460	35,254	2031/09/17	
NORWAY 3.5 10/06/42	国債証券	3.5000	2,200	2,166	31,049	2042/10/06	
小計	—	—	32,620	29,940	429,040	—	
(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	3,990	4,443	64,482	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	3,390	3,159	45,848	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	5,920	5,870	85,174	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	4,920	4,191	60,812	2031/05/12	

銘柄	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	
(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 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	4,050	4,004	58,106	2032/06/01	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	8,210	7,852	113,945	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,960	3,622	52,565	2029/11/12	
SWEDEN 1.75 11/11/33	国債証券	1.7500	2,700	2,548	36,979	2033/11/11	
小計	—	—	37,140	35,693	517,914	—	
(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	36,282	33,436	294,374	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	25,080	22,431	197,487	2027/03/04	
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	3,680	3,495	30,777	2025/03/06	
MEXICAN BONDS 03/01/29	国債証券	8.5000	9,500	9,173	80,763	2029/03/01	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	24,159	23,435	206,327	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,148	27,780	244,579	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	19,290	17,202	151,446	2033/05/26	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	28,146	26,588	234,081	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	13,290	11,397	100,340	2053/07/31	
MEXICAN BONDS 09/03/26	国債証券	7.0000	8,000	7,502	66,049	2026/09/03	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	24,707	21,151	186,219	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	19,561	17,001	149,680	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,631	128,813	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,803	51,092	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	10,035	9,020	79,413	2034/11/23	
小計	—	—	273,005	250,053	2,201,447	—	
(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 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	15,500	15,832	329,979	2032/02/17	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	国債証券	2.8800	11,200	11,589	241,546	2033/02/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	40,500	40,634	846,893	2025/02/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	19,100	21,625	450,709	2050/03/16	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	11,253	234,531	2029/03/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	3.0300	54,000	55,050	1,147,353	2026/03/11	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	国債証券	2.8000	10,000	10,231	213,231	2030/03/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	15,820	17,880	372,661	2052/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	7,600	9,140	190,494	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	国債証券	3.1900	8,500	9,524	198,515	2053/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	25,100	25,320	527,716	2027/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	18,500	19,263	401,475	2031/05/27	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	9,000	9,195	191,659	2032/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	国債証券	2.6700	14,500	14,741	307,229	2033/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国債証券	3.0100	54,000	55,641	1,159,653	2028/05/13	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	国債証券	3.2900	4,000	4,205	87,647	2029/05/23	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	64,600	65,640	1,368,063	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	国債証券	2.3000	39,500	39,609	825,527	2026/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,500	177,163	2025/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	23,500	23,977	499,730	2027/06/04	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	22,000	22,447	467,837	2029/06/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	18,450	18,952	395,004	2026/06/06	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	国債証券	2.6200	10,000	10,119	210,916	2030/06/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	国債証券	3.8600	5,800	7,059	147,125	2049/07/22	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	国債証券	2.4000	25,000	25,102	523,181	2028/07/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,567	428,669	2027/07/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	21,000	21,379	445,593	2032/08/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	20,000	20,016	417,187	2025/08/25	

銘	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	
(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 2.69 08/12/26		国債証券	2.6900	60,600	61,382	1,279,310	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27		国債証券	3.5900	5,000	5,262	109,681	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26		国債証券	2.1800	42,000	41,999	875,345	2026/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50		国債証券	3.8100	17,500	21,268	443,269	2050/09/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32		国債証券	2.6000	18,300	18,441	384,348	2032/09/01
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30		国債証券	2.6000	3,000	3,034	63,243	2030/09/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29		国債証券	2.6200	18,000	18,257	380,521	2029/09/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52		国債証券	3.1200	9,500	10,348	215,677	2052/10/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51		国債証券	3.5300	12,450	14,536	302,960	2051/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48		国債証券	4.0800	10,300	12,842	267,651	2048/10/22
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28		国債証券	2.9100	29,100	29,934	623,887	2028/10/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27		国債証券	2.4400	21,000	21,134	440,477	2027/10/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32		国債証券	2.8000	31,300	32,050	667,976	2032/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31		国債証券	2.8900	15,100	15,568	324,466	2031/11/18
CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30		国債証券	3.2700	3,000	3,166	65,990	2030/11/19
CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29		国債証券	3.1300	8,000	8,341	173,843	2029/11/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25		国債証券	2.2800	31,800	31,878	664,392	2025/11/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26		国債証券	2.3900	22,000	22,131	461,263	2026/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30		国債証券	2.5400	3,000	3,021	62,981	2030/12/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29		国債証券	2.7900	24,000	24,550	511,670	2029/12/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27		国債証券	3.2800	18,500	19,287	401,976	2027/12/03
小計		—	—	1,000,520	1,032,940	21,528,239	—
(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	1,000	1,011	31,652	2027/03/15
MALAYSIA 4.457 03/31/53		国債証券	4.4570	2,000	2,077	64,985	2053/03/31
MALAYSIA 4.736 03/15/46		国債証券	4.7360	300	324	10,155	2046/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26		国債証券	4.3920	1,050	1,070	33,485	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30		国債証券	4.4980	1,200	1,250	39,132	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33		国債証券	3.8440	1,660	1,655	51,799	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37		国債証券	4.7620	1,700	1,835	57,423	2037/04/07
MALAYSIA 2.632 04/15/31		国債証券	2.6320	1,100	1,020	31,914	2031/04/15
MALAYSIA 4.504 04/30/29		国債証券	4.5040	2,950	3,068	96,012	2029/04/30
MALAYSIA 3.502 05/31/27		国債証券	3.5020	650	650	20,346	2027/05/31
MALAYSIA 3.757 05/22/40		国債証券	3.7570	1,500	1,447	45,274	2040/05/22
MALAYSIA 4.254 05/31/35		国債証券	4.2540	1,400	1,437	44,977	2035/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28		国債証券	3.7330	2,000	2,008	62,822	2028/06/15
MALAYSIA 4.232 06/30/31		国債証券	4.2320	670	687	21,501	2031/06/30
MALAYSIA 4.065 06/15/50		国債証券	4.0650	1,700	1,664	52,076	2050/06/15
MALAYSIA 4.921 07/06/48		国債証券	4.9210	1,990	2,203	68,947	2048/07/06
MALAYSIA 3.906 07/15/26		国債証券	3.9060	1,920	1,942	60,766	2026/07/15
MALAYSIA 3.828 07/05/34		国債証券	3.8280	1,820	1,811	56,668	2034/07/05
MALAYSIA 3.582 07/15/32		国債証券	3.5820	1,400	1,372	42,924	2032/07/15
MALAYSIA 3.885 08/15/29		国債証券	3.8850	700	707	22,148	2029/08/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25		国債証券	3.9550	1,950	1,964	61,467	2025/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43		国債証券	4.9350	1,600	1,767	55,286	2043/09/30
MALAYSIA 4.696 10/15/42		国債証券	4.6960	960	1,035	32,410	2042/10/15
MALAYSIA 3.9 11/30/26		国債証券	3.9000	1,660	1,679	52,550	2026/11/30
MALAYSIA 3.899 11/16/27		国債証券	3.8990	1,730	1,752	54,811	2027/11/16
MALAYSIA 4.642 11/07/33		国債証券	4.6420	1,450	1,540	48,191	2033/11/07
小計		—	—	38,060	38,987	1,219,734	—

銘柄	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
				千ユーロ	千円			
(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	3,190	3,265	122,805		2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,460	3,162	118,954		2028/04/25	
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	5,440	4,178	157,143		2032/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	4,170	3,973	149,430		2025/04/25	
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	3,650	3,511	132,070		2027/05/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	3,290	3,104	116,759		2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	1,590	1,551	58,339		2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,360	2,175	81,802		2027/07/25	
POLAND 7.5 07/25/28	国債証券	7.5000	3,400	3,709	139,526		2028/07/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	2,000	1,767	66,476		2029/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	4,720	3,684	138,558		2030/10/25	
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,880	1,661	62,470		2026/10/25	
小計	—	—	39,150	35,744	1,344,336		—	
(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	840	708	115,032		2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	660	608	98,854		2031/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	590	602	97,848		2025/03/13	
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	250	169	27,533		2041/04/22	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	650	472	76,713		2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	290	257	41,861		2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	960	951	154,412		2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	710	664	107,847		2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	730	678	110,182		2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	1,120	1,079	175,166		2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	780	678	110,181		2037/05/15	
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	370	286	46,572		2035/05/15	
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	420	389	63,203		2027/05/15	
IRISH 3.0 10/18/43	国債証券	3.0000	210	211	34,264		2043/10/18	
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	670	550	89,393		2031/10/18	
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	600	495	80,386		2032/10/18	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	350	300	48,749		2030/10/18	
小計	—	—	10,200	9,105	1,478,204		—	
(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	1,320	1,495	242,756		2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,710	1,708	277,407		2047/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,430	688	111,827		2052/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	1,090	1,202	195,264		2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,320	1,489	241,846		2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,310	1,301	211,215		2033/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	990	675	109,626		2038/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,310	929	150,963		2040/01/15	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	660	563	91,466		2054/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	1,030	911	147,947		2029/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,280	1,187	192,795		2027/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	2,180	2,065	335,374		2026/01/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,820	1,727	280,449		2026/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,480	1,371	222,591		2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,460	1,374	223,123		2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,360	1,206	195,842		2029/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	700	596	96,847		2030/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,900	1,577	256,126		2031/07/15	

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 2.5 07/15/33	国債証券	2.5000	350	346	56,179	2033/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	1,000	844	137,122	2032/07/15
小 計	—	—	25,700	23,264	3,776,775	—
(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	1,600	1,776	288,389	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,280	1,450	235,491	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,070	1,105	179,418	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	930	1,013	164,453	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,570	1,867	303,248	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	1,110	973	158,033	2033/04/22
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500	320	304	49,401	2039/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	640	683	110,954	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	920	664	107,920	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	960	686	111,405	2050/06/22
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	1,390	889	144,352	2053/06/22
BELGIUM 3.3 06/22/54	国債証券	3.3000	270	264	43,005	2054/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	390	304	49,363	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	450	336	54,614	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	870	366	59,536	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,460	1,401	227,450	2026/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,570	1,393	226,228	2031/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	940	867	140,834	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	930	600	97,519	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,350	1,235	200,622	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	580	584	94,898	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	610	523	84,915	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,380	1,337	217,178	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	1,210	1,138	184,787	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	780	641	104,095	2037/06/22
BELGIUM 3.45 06/22/43	国債証券	3.4500	240	245	39,829	2043/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	1,200	1,022	166,015	2030/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/33	国債証券	3.0000	1,200	1,213	197,039	2033/06/22
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500	1,050	861	139,842	2032/06/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	1,040	845	137,314	2031/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	1,080	980	159,248	2027/10/22
小 計	—	—	30,390	27,580	4,477,411	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	3,700	3,413	554,081	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	3,530	3,335	541,536	2026/02/25
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500	3,780	3,509	569,691	2028/02/25
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	国債証券	2.7500	3,100	3,112	505,345	2029/02/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	1,570	1,515	245,982	2025/03/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	3,850	3,903	633,708	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,690	3,164	513,653	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,530	1,728	280,656	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,460	1,673	271,725	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	3,100	3,518	571,247	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	2,330	2,729	443,077	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	2,540	2,541	412,649	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,950	1,539	249,906	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	3,720	2,568	416,982	2050/05/25

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…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	3,470	1,878	305,020	2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	3,660	1,938	314,732	2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	940	636	103,318	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	790	306	49,798	2072/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	4,650	4,611	748,628	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,090	4,707	764,175	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	5,780	5,338	866,601	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	3,430	3,317	538,591	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	3,590	3,218	522,455	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	3,560	3,051	495,395	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	4,960	4,712	765,097	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	3,560	3,374	547,800	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,950	1,298	210,748	2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	4,080	3,353	544,449	2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	900	708	115,058	2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国債証券	2.5000	1,200	1,073	174,267	2043/05/25
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	国債証券	3.0000	3,000	3,046	494,567	2033/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	2,790	2,232	362,342	2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	2,450	2,055	333,667	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,490	893	145,019	2044/06/25
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	国債証券	2.5000	4,120	4,090	664,120	2026/09/24
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,170	2,274	369,268	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	3,240	3,247	527,129	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	2,040	2,258	366,661	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,610	3,196	518,890	2032/10/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,740	2,649	430,136	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	4,020	3,757	609,921	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	4,600	4,216	684,425	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	3,670	2,983	484,326	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	4,280	3,582	581,580	2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国債証券	2.0000	3,850	3,622	588,020	2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	3,590	3,090	501,787	2029/11/25
小 計	-	-	141,120	128,977	20,938,250	-
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,310	1,460	237,126	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	840	1,017	165,110	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	2,620	3,139	509,635	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	2,030	2,365	383,970	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,650	1,606	260,751	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	3,860	3,693	599,524	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,430	1,292	209,847	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	2,120	1,970	319,897	2028/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,420	2,264	367,601	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	2,340	1,999	324,656	2031/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	3,050	3,045	494,359	2033/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	2,500	2,086	338,727	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,720	1,502	243,849	2030/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	700	698	113,433	2033/02/15
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,590	1,534	249,117	2025/04/11
BUNDESUBL 2.2 04/13/28	国債証券	2.2000	2,100	2,083	338,203	2028/04/13
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	3,510	3,315	538,291	2026/04/10

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	
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	2,060	1,906	309,455	2027/04/16	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,760	1,344	218,291	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000	1,660	1,358	220,475	2038/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,880	1,394	226,448	2036/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	650	731	118,831	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,180	1,292	209,857	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,730	2,097	340,472	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,330	1,456	236,518	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,320	2,289	371,653	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,610	2,075	336,902	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	2,020	2,450	397,834	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,240	2,215	359,662	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	2,540	1,258	204,270	2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	1,850	1,571	255,105	2053/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	2,820	2,164	351,439	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	2,420	2,350	381,540	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,610	2,443	396,671	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	3,590	3,367	546,672	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	2,570	2,344	380,561	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	2,290	2,021	328,216	2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	3,140	1,632	264,969	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000	2,330	2,222	360,879	2032/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	2,890	2,443	396,601	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,010	527	85,639	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	3,730	3,223	523,261	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	890	768	124,796	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	1,100	929	150,960	2031/08/15	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	2,760	2,580	418,939	2026/10/09	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	2,650	2,529	410,601	2025/10/10	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	2,280	2,191	355,829	2027/10/15	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	1,050	1,009	163,950	2027/10/15	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,350	1,290	209,524	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,620	1,481	240,547	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,560	2,295	372,664	2028/11/15	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	国債証券	2.4000	300	301	48,942	2030/11/15	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000	2,000	1,975	320,653	2029/11/15	
小計	-	-	108,580	100,614	16,333,748	-	
(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	1,960	2,238	363,423	2029/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,660	1,792	290,935	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,330	1,288	209,149	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	1,910	1,755	284,907	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,880	1,678	272,436	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	1,640	1,548	251,458	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,630	1,598	259,500	2025/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,510	1,446	234,837	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,730	1,693	274,938	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	2,170	2,044	331,931	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,500	1,396	226,756	2029/04/30	
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,850	1,533	248,942	2032/04/30	
SPAIN 3.15 04/30/33	国債証券	3.1500	1,570	1,565	254,101	2033/04/30	

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	1,800	1,553	252,120	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,880	1,527	247,974	2031/04/30
SPAIN 3.5 05/31/29	国債証券	3.5000	500	513	83,408	2029/05/31
SPAIN 2.8 05/31/26	国債証券	2.8000	1,800	1,792	290,984	2026/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	870	835	135,584	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	2,330	2,488	403,962	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,910	2,202	357,479	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,880	2,135	346,662	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,120	1,012	164,419	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,895	1,933	313,918	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,770	1,665	270,353	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,965	2,350	381,630	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,870	1,740	282,629	2033/07/30
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	740	710	115,353	2043/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	2,170	2,038	330,964	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,940	1,667	270,762	2035/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	1,600	1,149	186,678	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	540	348	56,648	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,550	1,443	234,289	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	1,700	1,513	245,744	2029/07/30
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	2,060	2,256	366,374	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,210	1,457	236,662	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,300	1,134	184,116	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,560	1,292	209,805	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	1,270	846	137,401	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	660	321	52,136	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,790	963	156,389	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,810	1,784	289,724	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,860	1,768	287,018	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	2,630	2,521	409,413	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	2,130	1,872	303,968	2029/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	2,140	1,769	287,305	2031/10/31
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,720	1,644	266,943	2032/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,810	1,261	204,801	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	2,450	2,187	355,135	2030/10/31
SPAIN 3.55 10/31/33	国債証券	3.5500	1,820	1,867	303,199	2033/10/31
小計	-	-	82,390	77,154	12,525,285	-
(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	1,710	1,603	260,306	2027/01/15
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	1,310	1,316	213,707	2026/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	2,660	3,071	498,627	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,470	1,472	239,117	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	2,540	2,430	394,583	2028/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,610	1,528	248,192	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	1,800	1,566	254,297	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,270	989	160,649	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,690	1,491	242,136	2048/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	400	289	47,000	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	360	216	35,094	2072/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	2,110	2,163	351,237	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	2,290	1,983	322,022	2032/03/01

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	期		末		
									評			額	償
									外	貨			
(ユーロ…イタリア)					%			千ユーロ		千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国	債	証	券	3.1000		1,060		927		150,556	2040/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国	債	証	券	3.3500		2,120		2,014		327,063	2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国	債	証	券	3.5000		2,170		2,183		354,505	2030/03/01	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国	債	証	券	1.4500		1,320		1,005		163,245	2036/03/01	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国	債	証	券	1.8000		1,150		818		132,867	2041/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国	債	証	券	0.9500		1,480		1,026		166,718	2037/03/01	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国	債	証	券	3.2500		600		545		88,579	2038/03/01	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	国	債	証	券	4.2000		400		412		66,994	2034/03/01	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国	債	証	券	0.2500		1,460		1,299		210,944	2028/03/15	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国	債	証	券	4.0000		1,160		1,171		190,235	2035/04/30	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国	債	証	券	1.5000		1,110		694		112,713	2045/04/30	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国	債	証	券	1.3500		1,550		1,375		223,276	2030/04/01	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国	債	証	券	0.9000		2,110		1,766		286,838	2031/04/01	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国	債	証	券	3.4000		1,150		1,158		188,072	2028/04/01	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国	債	証	券	0.0000		2,020		1,890		306,906	2026/04/01	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国	債	証	券	1.1000		1,300		1,221		198,368	2027/04/01	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	国	債	証	券	3.8000		1,500		1,519		246,661	2026/04/15	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国	債	証	券	6.0000		2,260		2,621		425,553	2031/05/01	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国	債	証	券	1.4500		1,430		1,397		226,943	2025/05/15	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国	債	証	券	4.4000		1,600		1,685		273,614	2033/05/01	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国	債	証	券	1.6000		2,850		2,753		447,077	2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国	債	証	券	1.5000		1,560		1,524		247,437	2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国	債	証	券	2.2000		1,590		1,544		250,738	2027/06/01	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国	債	証	券	0.9500		1,580		1,282		208,224	2032/06/01	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国	債	証	券	2.8000		1,200		1,169		189,781	2029/06/15	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	国	債	証	券	3.7000		1,400		1,418		230,276	2030/06/15	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国	債	証	券	2.1000		1,790		1,747		283,749	2026/07/15	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国	債	証	券	0.5000		1,100		979		159,002	2028/07/15	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国	債	証	券	1.8500		1,240		1,215		197,396	2025/07/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国	債	証	券	5.0000		2,360		2,591		420,706	2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国	債	証	券	5.0000		1,890		2,063		335,050	2039/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国	債	証	券	2.0500		1,700		1,639		266,236	2027/08/01	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国	債	証	券	3.0000		2,210		2,173		352,882	2029/08/01	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国	債	証	券	0.6000		1,920		1,554		252,364	2031/08/01	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国	債	証	券	0.9500		1,350		1,156		187,819	2030/08/01	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国	債	証	券	1.2000		1,360		1,318		214,039	2025/08/15	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国	債	証	券	0.0000		1,850		1,714		278,404	2026/08/01	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国	債	証	券	2.9500		1,520		1,321		214,555	2038/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国	債	証	券	4.7500		1,560		1,658		269,197	2044/09/01	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国	債	証	券	3.2500		1,380		1,185		192,407	2046/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国	債	証	券	4.7500		2,180		2,316		376,027	2028/09/01	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国	債	証	券	5.0000		1,650		1,802		292,638	2040/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国	債	証	券	2.4500		1,200		863		140,183	2050/09/01	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国	債	証	券	1.7000		1,120		677		110,034	2051/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国	債	証	券	2.4500		1,330		1,195		194,047	2033/09/01	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国	債	証	券	2.1500		960		632		102,624	2052/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国	債	証	券	3.8500		1,380		1,290		209,522	2049/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国	債	証	券	2.2500		1,360		1,128		183,161	2036/09/01	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	国	債	証	券	4.4500		800		816		132,586	2043/09/01	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国	債	証	券	0.9500		1,680		1,556		252,712	2027/09/15	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	国	債	証	券	3.8500		1,500		1,524		247,503	2026/09/15	

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	
(ユーロ…イタリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	国債証券	4.5000	670	684	111,073	2053/10/01	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	国債証券	4.0000	1,400	1,441	234,048	2031/10/30	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	1,250	1,381	224,293	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	2,010	2,242	363,991	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	2,640	2,902	471,221	2029/11/01	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	1,550	1,531	248,654	2025/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	1,660	1,625	263,935	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	2,180	2,072	336,527	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,940	1,902	308,884	2028/12/01	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	1,700	1,400	227,412	2031/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	2,140	1,904	309,105	2030/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,340	1,224	198,827	2032/12/01	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国債証券	3.8500	1,700	1,740	282,518	2029/12/15	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国債証券	2.6500	1,720	1,688	274,059	2027/12/01	
小 計	-	-	122,640	116,425	18,900,577	-	
(ユーロ…フィンランド)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券	0.1250	640	298	48,521	2052/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	600	524	85,162	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	380	276	44,937	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	460	438	71,143	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	480	407	66,172	2034/04/15	
FINLAND 2.75 04/15/38	国債証券	2.7500	370	356	57,931	2038/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券	0.5000	380	239	38,880	2043/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	280	199	32,347	2036/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/27	国債証券	1.3750	210	201	32,734	2027/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	220	222	36,135	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	320	321	52,181	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	330	309	50,246	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	800	711	115,483	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	810	784	127,336	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	650	590	95,917	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	400	370	60,186	2027/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	290	185	30,036	2040/09/15	
FINLAND 1.5 09/15/32	国債証券	1.5000	700	632	102,699	2032/09/15	
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	700	576	93,646	2031/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	510	428	69,583	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/26	国債証券	0.0000	100	93	15,124	2026/09/15	
小 計	-	-	9,630	8,170	1,326,408	-	
(ユーロ…オーストリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	310	357	58,062	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	740	549	89,179	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	1,520	1,366	221,903	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	935	867	140,901	2028/02/20	
AUSTRIA 2.9 02/20/34	国債証券	2.9000	150	150	24,387	2034/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	1,410	1,165	189,278	2031/02/20	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	国債証券	2.9000	1,300	1,306	212,033	2033/02/20	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000	600	519	84,364	2032/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	1,180	1,006	163,383	2030/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	1,210	1,257	204,062	2026/03/15	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	1,010	1,131	183,652	2037/03/15	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	590	344	55,892	2051/03/20	

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 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	410	185	30,075	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	1,340	1,251	203,166	2027/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	870	832	135,183	2034/05/23
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	590	464	75,354	2049/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	310	140	22,859	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	550	552	89,772	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	615	684	111,049	2027/07/15
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	460	451	73,309	2026/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	295	47,998	2117/09/20
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,330	1,263	205,073	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	890	864	140,395	2025/10/20
AUSTRIA 3.15 10/20/53	国債証券	3.1500	420	423	68,799	2053/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	840	598	97,092	2036/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	450	271	44,131	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	620	547	88,955	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	190	113	18,478	2086/11/02
小 計	—	—	21,230	18,965	3,078,798	—
合 計	—	—	—	—	256,938,107	—

■投資信託財産の構成

2024年2月21日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比	評 価 額	率
公 社 債	千円	%		
コーポレート債	256,938,107	98.3		
コール・ローン等、その他	4,534,468	1.7		
投資信託財産総額	261,472,575	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、259,685,707千円、99.3%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、2024年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.16円、1カナダ・ドル=111.02円、1オーストラリア・ドル=98.41円、1シンガポール・ドル=111.73円、1ニュージーランド・ドル=92.63円、1イギリス・ポンド=189.58円、1イスラエル・シケル=40.76円、1デンマーク・クローネ=21.78円、1ノルウェー・クローネ=14.33円、1スウェーデン・クローナ=14.51円、1メキシコ・ペソ=8.803円、1オフショア・人民元=20.841円、1マレーシア・リンギット=31.284円、1ポーランド・ズロチ=37.609円、1ユーロ=162.34円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	262,047,572,911円
コ ー ル ・ 公 社 債 (評価額)	2,571,862,881
未 収 入 金 息 用 意	256,938,107,694
未 払 収 入 利 費	575,027,153
未 払 収 入 費	1,747,978,124
(B) 負 債	1,654,049,105
未 払 収 入 金	1,628,558,105
未 払 収 入 金	25,491,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	260,393,523,806
元 次 本 金	112,140,675,109
(D) 受 益 権 益 総 額	148,252,848,697
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	112,140,675.109円
	23,220円

(注1) 期首元本額	92,568,430,085円	Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	95,009,306円
追加設定元本額	57,122,203,209円	D I AMパッシブ資産分散ファンド	989,890,513円
一部解約元本額	37,549,958,225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)	237,386,300円
(注2) 期末における元本の内訳		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)	238,317,641円
D I AM外国債券パッシブ・ファンド	6,936,625,396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)	95,585,889円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,145,444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)	143,381,639円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	13,898,297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)	544,565円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	33,055,375円	インカム重視マルチアセット運用ファンド I I 2021-04 (適格機関投資家限定)	621,159,184円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,463,237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・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	543,853,224円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,934,640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)	211,165,647円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,209,559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・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	866,888,247円
たわらノーロード 先進国債券	20,317,116,345円	予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	634,044,700円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	129,335円	D I AM海替フルレンジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	4,747,484,094円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,175,860,175円	D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	1,364,728,567円
たわらノーロード バランス (堅実型)	70,372,889円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,512,206,226円
たわらノーロード バランス (標準型)	393,159,511円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,272,436,982円
たわらノーロード バランス (積極型)	90,074,981円	A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	222,937,463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)	17,547,319円	D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	43,680,338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)	1,061,778,662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)	393,718,174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)	1,874,531,468円	D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	322,665,524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)	939,477,666円	D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	208,816,275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)	721,685,160円	D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,704,671円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,181,174円	D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	20,619,600円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	12,367,147円	D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,524,169円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	192,544,517円	D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	51,265円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	20,620,422円	D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,512,264円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	38,634,144円	D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	33,413,721円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,881,458,772円	D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,252,683,690円
One DC 先進国債券インデックスファンド	1,443,766,551円	D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,244,567,605円
Oneグローバルバランス	60,758,637円	D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,359,122,210円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	734,747,927円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	50,385,127円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,430,100,443円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	100,205,864円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,916,905,681円	D I AM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)	1,142,198,851円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	415,782,480円	D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	202,876,714円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円	D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	155,039円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	822,838,550円	D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	199,846,920円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	23,358,394円	D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	259,826,276円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	887,363,869円	D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	336,700,092円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	15,215,627円	D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	33,520,121円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	159,329,380円	動的パッケージファンド<DC年金>	48,713,270円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	160,868,965円	コア資産形成ファンド	24,325,247円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	260,318,009円	たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	4,593,798,610円
クルーズコントロール	1,073,014,665円	たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	12,277,305,584円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円	MH AM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	5,666,776,191円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	854,009,676円	MH AM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	4,945,479,083円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	699,203,724円	期末元本合計	112,140,675,109円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,400,751円		
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	488,705,414円		
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	5,190,355円		

■損益の状況

当期 自2023年2月22日 至2024年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	5,766,181,304	円
	受取利息	5,766,646,977	
	その他の収益	5,079	
	支払利息	△470,752	
(B)	有価証券売買損益	26,829,583,002	
	売却益	30,605,561,933	
	売却損	△3,775,978,931	
(C)	その他の費用	△34,657,163	
(D)	当期損益金(A+B+C)	32,561,107,143	
(E)	前期繰越損益金	94,253,940,578	
(F)	解約差損益金	△43,521,353,795	
(G)	追加信託差損益金	64,959,154,771	
(H)	計(D+E+F+G)	148,252,848,697	
	次期繰越損益金(H)	148,252,848,697	

(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。