

運用報告書 (全体版)

第5期<決算日2020年10月12日>

たわらノーロード 先進国債券

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	2015年12月18日から無期限です。				
運用方針	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) 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	<table border="1"> <tr> <td>たわらノーロード 先進国債券</td> <td>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。</td> </tr> <tr> <td>外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド</td> <td>海外の公社債を主要投資対象とします。</td> </tr> </table>	たわらノーロード 先進国債券	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。
たわらノーロード 先進国債券	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	マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。				
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。外貨建資産への実質投資割合には、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%未満とします。				
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、経費控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額を分配対象額とし、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、「たわらノーロード 先進国債券」は、2020年10月12日に第5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/>

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、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 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率			
(設定日) 2015年12月18日	円 10,000	円 -	% -	ポイント (12月17日) 117,821.69	% -	% -	% -	百万円 1
1期 (2016年10月12日)	8,876	0	△11.2	103,992.55	△11.7	97.4	-	707
2期 (2017年10月12日)	9,836	0	10.8	115,318.15	10.9	96.8	-	1,920
3期 (2018年10月12日)	9,554	0	△2.9	112,209.80	△2.7	97.4	-	4,934
4期 (2019年10月15日)	9,987	0	4.5	117,767.24	5.0	97.8	-	9,906
5期 (2020年10月12日)	10,547	0	5.6	124,690.29	5.9	98.8	-	17,455

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(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。

(注4) 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5) 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6) △ (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) 2019 年 10 月 15 日	9,987	% -	ポイ ント 117,767.24	% -	% 97.8	% -
10 月 末	10,052	0.7	118,313.83	0.5	97.6	-
11 月 末	10,056	0.7	118,546.99	0.7	97.4	-
12 月 末	10,100	1.1	118,980.17	1.0	96.6	-
2020 年 1 月 末	10,180	1.9	120,069.31	2.0	96.7	-
2 月 末	10,298	3.1	121,401.29	3.1	97.3	-
3 月 末	10,308	3.2	121,796.59	3.4	97.4	-
4 月 末	10,111	1.2	119,329.72	1.3	96.1	-
5 月 末	10,254	2.7	120,973.12	2.7	97.2	-
6 月 末	10,415	4.3	123,063.01	4.5	98.4	-
7 月 末	10,517	5.3	123,870.50	5.2	99.0	-
8 月 末	10,504	5.2	124,064.52	5.3	99.3	-
9 月 末	10,551	5.6	124,690.18	5.9	97.8	-
(期 末) 2020 年 10 月 12 日	10,547	5.6	124,690.29	5.9	98.8	-

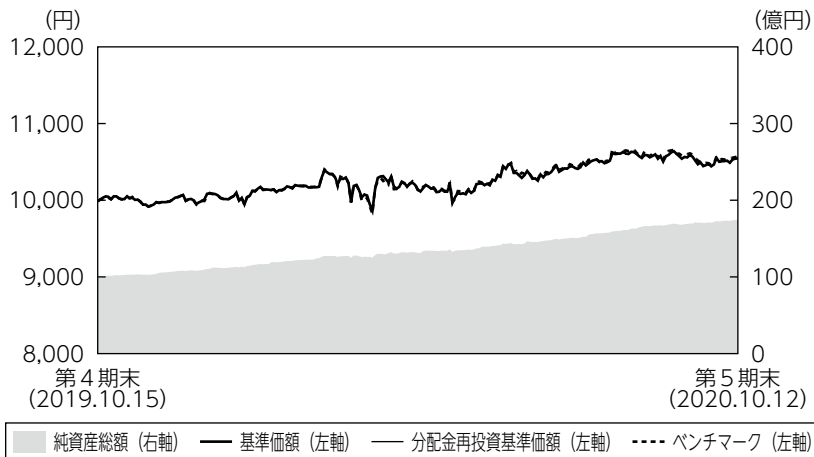
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2019年10月16日から2020年10月12日まで）

基準価額等の推移



第5期首： 9,987円
第5期末： 10,547円
(既払分配金0円)
騰落率： 5.6%
(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

新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念により、F R B（米連邦準備理事会）が緊急利下げを行ったことや、2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことから米国債の利回りが大幅に低下（価格は上昇）し、基準価額は上昇しました。為替市場でユーロ円が円安ユーロ高となったことも基準価額の上昇要因となりました。

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。新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念により、各中央銀行による大幅な金融緩和政策への期待感から債券が買われる展開となりました。

為替市場ではドル円は円高ドル安に、ユーロ円は円安ユーロ高となりました。新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念により、F R Bが緊急利下げを行い、金利が大幅に低下したことからドル円は円高ドル安になりました。ユーロ円はE U（欧州連合）による復興基金の創設やユーロ圏の経済指標の改善から円安ユーロ高となりました。

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。

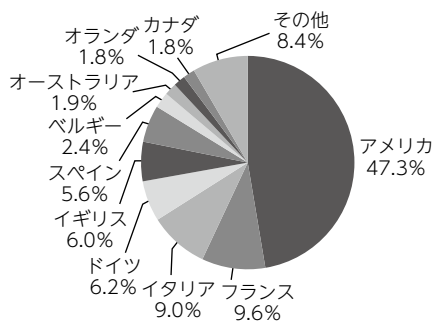
●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

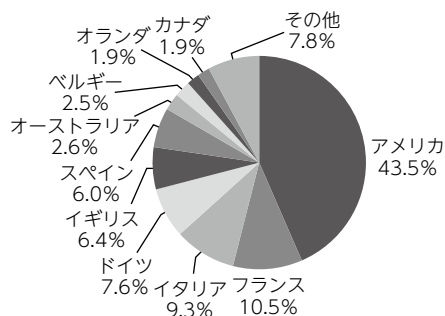
【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○国別配分

期首（前期末）



期末



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

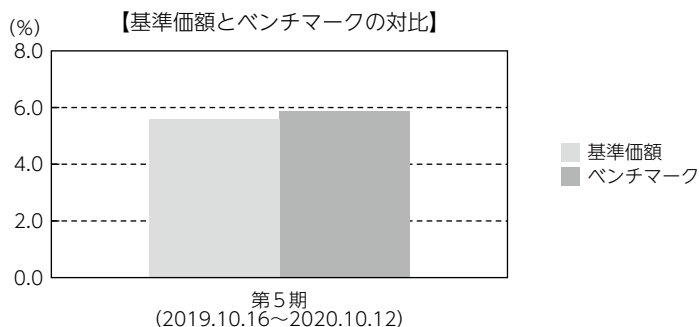
(注3) 上位11位以下をその他に含めて集計しています。

(注4) 発行国（地域）を表示しています。

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5.9%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した。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
	2019年10月16日 ～2020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	1,241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5期		項目の概要
	(2019年10月16日 ～2020年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	19円	0.185%	(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10,253円です。
(投信会社)	(8)	(0.082)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(8)	(0.082)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(2)	(0.022)	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
(b) その他費用	2	0.016	(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)	(1)	(0.012)	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)	(0)	(0.004)	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)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	21	0.201	

(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。

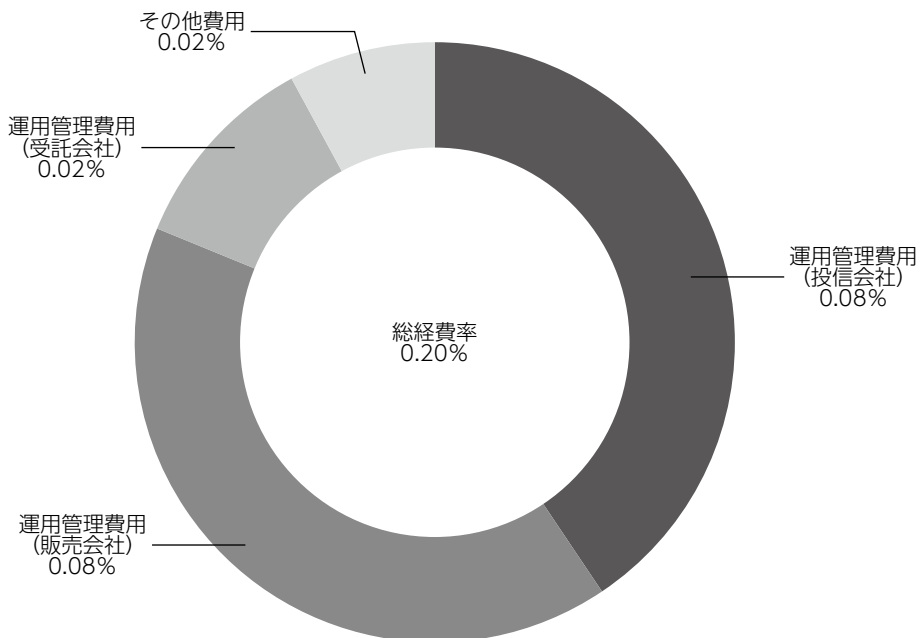
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.20%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（2019年10月16日から2020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□ 3,593,120	千円 6,960,358	千□ 90,070	千円 173,590

■利害関係人との取引状況等（2019年10月16日から2020年10月12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□ 5,265,551	千□ 8,768,601	千円 17,454,777

■投資信託財産の構成

2020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	17,454,777	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	27,470	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	17,482,247	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) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2020年10月12日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは129,874,234千円、99.7％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、2020年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.66円、1カナダ・ドル=80.44円、1オーストラリア・ドル=76.23円、1シンガポール・ドル=77.98円、1イギリス・ポンド=137.63円、1イスラエル・シェケル=31.27円、1デンマーク・クローネ=16.77円、1ノルウェー・クローネ=11.55円、1スウェーデン・クローナ=12.00円、1メキシコ・ペソ=4.99円、1マレーシア・リングギット=25.53円、1ポーランド・ズロチ=27.91円、1ユーロ=124.78円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	17,482,247,962円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	27,470,340
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	17,454,777,622
(B) 負 債	26,397,513
未 払 解 約 金	12,040,511
未 払 信 託 報 酬	14,080,760
そ の 他 未 払 費 用	276,242
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	17,455,850,449
元 本	16,549,924,219
次 期 繰 越 損 益 金	905,926,230
(D) 受 益 権 総 口 数	16,549,924,219口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	10,547円

(注) 期首における元本額は9,919,610,669円、当期中における追加設定元本額は9,560,056,722円、同解約元本額は2,929,743,172円です。

■損益の状況

当期 自2019年10月16日 至2020年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△13,947円
受 取 利 息	1,345
支 払 利 息	△15,292
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	699,482,697
売 買 益	763,304,908
売 買 損	△63,822,211
(C) 信 託 報 酬 等	△25,445,666
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	674,023,084
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	234,622,943
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,719,797
(配 当 等 相 当 額)	(1,138,209,746)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,140,929,543)
(G) 合 計(D+E+F)	905,926,230
次 期 繰 越 損 益 金(G)	905,926,230
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,719,797
(配 当 等 相 当 額)	(1,145,270,517)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,147,990,314)
分 配 準 備 積 立 金	908,646,027

(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	282,185,610円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	391,837,474
(c) 収 益 調 整 金	1,145,270,517
(d) 分 配 準 備 積 立 金	234,622,943
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	2,053,916,544
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	1,241.04
(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17期（決算日 2020年2月21日）

（計算期間 2019年2月22日～2020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17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		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
13期（2016年2月22日）	17,881	△5.0	ポイント 111,769.89	% △5.0	% 97.6	% -	百万円 267,780
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9	108,792.68	△2.7	97.9	-	248,485
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803

（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）。

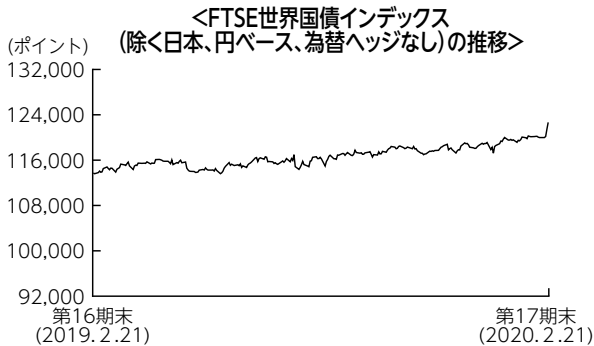
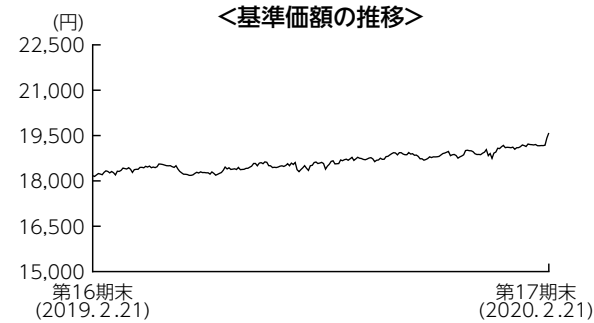
■当期中の基準価額と市況の推移

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 率	債券先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019 年 2 月 21 日	円 18,170	% -	ポイント 113,733.36	% -	% 98.1	% -
2 月 末	18,204	0.2	113,937.65	0.2	98.1	-
3 月 末	18,446	1.5	115,474.58	1.5	97.9	-
4 月 末	18,395	1.2	115,213.50	1.3	97.4	-
5 月 末	18,249	0.4	114,188.44	0.4	98.1	-
6 月 末	18,486	1.7	115,685.41	1.7	97.5	-
7 月 末	18,542	2.0	115,950.32	1.9	97.6	-
8 月 末	18,666	2.7	116,876.64	2.8	97.5	-
9 月 末	18,755	3.2	117,408.61	3.2	97.5	-
10 月 末	18,937	4.2	118,313.83	4.0	97.6	-
11 月 末	18,947	4.3	118,546.99	4.2	97.4	-
12 月 末	19,033	4.7	118,980.17	4.6	96.6	-
2020 年 1 月 末	19,188	5.6	120,069.31	5.6	96.8	-
(期 末) 2020 年 2 月 21 日	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-

(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（2019年2月22日から2020年2月21日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は19,586円となり、前期末比で7.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国債、ドイツ債の利回りは、ともに低下（価格は上昇）しました。米中貿易摩擦やブレグジット（英国のEU離脱）等の不透明感があり、FRB（米連邦準備理事会）が政策金利を引き下げ、ECB（欧州中央銀行）も追加的に金融緩和したことから、利回りは低下しました。その後、米中貿易協議やブレグジット交渉の進展見込みから利回りは上昇（価格は下落）に転じる場面もありましたが、新型コロナウイルス感染症の流行による世界的な景気減速懸念もあり、利回りは低下しました。これらを主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、ドイツ債の利回りは、ともに低下しました。米中貿易摩擦やブレグジット等の不透明感があり、FRBが政策金利を引き下げ、ECBも追加的に金融緩和したことから、利回りは低下しました。その後、米中貿易協議やブレグジット交渉の進展見込みから利回りは上昇に転じる場面もありましたが、新型コロナウイルス感染症の流行による世界的な景気減速懸念もあり、利回りは低下しました。

為替市場ではドル／円は円安ドル高に、ユーロ／円は円高ユーロ安となりました。ドル／円は、米中貿易摩擦の激化やFRBによる政策金利の引き下げから、円高ドル安が進む展開となりました。しかし米中貿易摩擦が一時緩和し、堅調な労働市場や底堅い個人消費などを背景として緩やかに景気拡大していることから、前期末比では円安ドル高となりました。ユーロ／円は、景気減速懸念からECBが追加的な金融緩和策を実施し円高ユーロ安となりました。

ポートフォリオについて

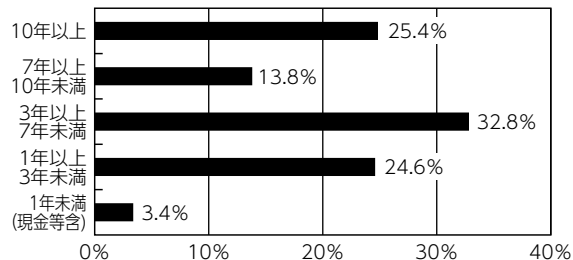
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

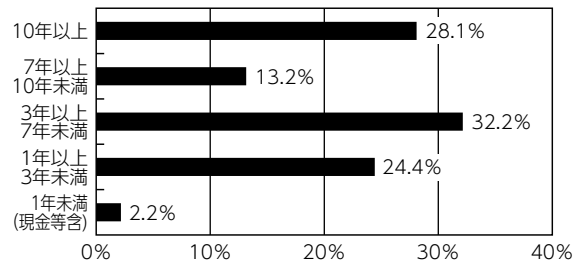
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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	45.6%	45.9%	△0.3%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.1%
計	47.5%	47.9%	△0.4%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.8%	△0.1%
計	0.7%	0.8%	△0.1%
欧州			
オーストリア	1.5%	1.5%	△0.0%
ベルギー	2.4%	2.5%	△0.0%
フィンランド	0.7%	0.6%	0.0%
フランス	9.9%	10.1%	△0.2%
ドイツ	6.6%	6.7%	△0.1%
アイルランド	0.8%	0.8%	0.0%
イタリア	8.6%	9.1%	△0.5%
オランダ	2.0%	2.0%	0.0%
スペイン	5.6%	5.9%	△0.3%
ユーロ計	38.2%	39.1%	△1.0%
デンマーク	0.5%	0.5%	△0.0%
スウェーデン	0.3%	0.4%	△0.0%
英国	6.7%	6.8%	△0.1%
ポーランド	0.6%	0.6%	△0.1%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	46.5%	47.7%	△1.2%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	2.1%	2.1%	△0.0%
シンガポール	0.3%	0.4%	△0.1%
マレーシア	0.4%	0.5%	△0.0%
計	2.8%	3.0%	△0.1%
アフリカ			
南アフリカ	0.5%	0.6%	△0.1%
計	0.5%	0.6%	△0.1%
現金など	1.9%	-	-
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	48.3%	48.8%	△0.5%
カナダ	1.8%	1.9%	△0.1%
計	50.1%	50.7%	△0.6%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.9%	△0.1%
計	0.7%	0.9%	△0.1%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	0.0%
ベルギー	2.3%	2.4%	△0.1%
フィンランド	0.5%	0.6%	△0.1%
フランス	9.5%	9.8%	△0.3%
ドイツ	5.7%	6.2%	△0.5%
アイルランド	0.7%	0.7%	0.0%
イタリア	8.9%	8.8%	0.1%
オランダ	1.8%	1.8%	0.0%
スペイン	5.3%	5.5%	△0.2%
ユーロ計	36.1%	37.2%	△1.1%
デンマーク	0.4%	0.5%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.3%	△0.1%
英国	6.2%	6.4%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.6%	△0.1%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.1%
計	43.7%	45.4%	△1.8%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.8%	1.9%	0.0%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.5%	0.1%
計	2.8%	2.8%	0.0%
アフリカ			
南アフリカ	0.5%	0.5%	0.0%
計	0.5%	0.5%	0.0%
現金など	1.6%	-	-
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7.9%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.06%と、ベンチマークには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	
	金 額	比 率
(a) そ の 他 費 用	2円	0.012%
（保 管 費 用）	(2)	(0.012)
（そ の 他）	(0)	(0.000)
合 計	2	0.012

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(18,642円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については6ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2019年2月22日から2020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 107,300	千アメリカ・ドル 405,150
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 188	千カナダ・ドル 19,520
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 3,427	千オーストラリア・ドル 25,741
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル -	千シンガポール・ドル 2,415
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 2,451	千イギリス・ポンド 44,126
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ -	千デンマーク・クローネ 25,089
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ -	千ノルウェー・クローネ 10,045
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 14,936	千スウェーデン・クローナ 47,435
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 8,060	千メキシコ・ペソ 117,770
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット -	千マレーシア・リンギット 2,205
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド -	千南アフリカ・ランド 42,074
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 1,276	千ポーランド・ズロチ 15,660
国	ユーロ圏	アイルランド	千ユーロ 833	千ユーロ 6,664
		オランダ	1,643	14,408
		ベルギー	1,491	17,459
		フランス	13,545	74,730
		ドイツ	5,785	51,063
		スペイン	3,915	41,082
		イタリア	9,222	62,374
		フィンランド	380	5,630
オーストリア	1,021	10,482		

(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 (2019年2月22日から2020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 526,820	千アメリカ・ドル 563,002	千円 63,118,202	% 48.3	% -	% 21.3	% 16.2	% 10.7	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 24,880	千カナダ・ドル 28,099	千円 2,377,248	1.8	-	0.9	0.5	0.3	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 27,560	千オーストラリア・ドル 32,336	千円 2,399,708	1.8	-	1.4	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 5,480	千シンガポール・ドル 5,986	千円 479,318	0.4	-	0.2	0.1	-	
イギリス	千イギリス・ポンド 41,680	千イギリス・ポンド 56,394	千円 8,145,652	6.2	-	5.1	1.1	-	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 26,340	千デンマーク・クローネ 35,998	千円 582,823	0.4	-	0.4	0.1	-	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 19,810	千ノルウェー・クローネ 20,550	千円 247,224	0.2	-	0.1	0.1	-	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 19,610	千スウェーデン・クローナ 23,326	千円 266,391	0.2	-	0.2	-	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 145,488	千メキシコ・ペソ 161,587	千円 961,447	0.7	-	0.5	0.2	-	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 27,550	千マレーシア・リンギット 29,527	千円 789,861	0.6	-	0.4	0.1	0.1	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 103,700	千南アフリカ・ランド 95,743	千円 710,419	0.5	-	0.5	0.0	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 22,900	千ポーランド・ズロチ 24,360	千円 688,666	0.5	-	0.2	0.3	-	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	6,250	7,364	890,608	0.7	-	0.5	0.1	-	
オランダ	16,070	19,688	2,380,903	1.8	-	1.2	0.4	0.2	
ベルギー	19,580	25,047	3,029,029	2.3	-	1.7	0.5	0.1	
フランス	83,180	102,810	12,432,844	9.5	-	6.5	2.5	0.5	
ドイツ	50,000	61,740	7,466,249	5.7	-	3.4	1.9	0.4	
スペイン	45,890	57,054	6,899,589	5.3	-	3.8	1.2	0.3	
イタリア	81,140	96,539	11,674,496	8.9	-	5.3	2.4	1.2	
フィンランド	4,710	5,396	652,595	0.5	-	0.4	0.1	-	
オーストリア	11,670	14,712	1,779,149	1.4	-	0.9	0.3	0.1	
合 計	-	-	千円 127,972,430	97.8	-	55.0	28.6	14.2	

(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			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 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,180	2,329	261,202	2026/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	350	361	40,575	2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	4,980	5,034	564,457	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	3,890	4,059	455,085	2024/01/31
US T N/B 2.5 01/15/22	国債証券	2.5000	3,850	3,928	440,373	2022/01/15
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	3,280	3,280	367,806	2025/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	840	1,062	119,172	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,380	1,682	188,591	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,440	1,754	196,702	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,970	2,175	243,891	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	900	1,149	128,819	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	490	644	72,276	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,000	1,386	155,491	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	730	1,017	114,058	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,200	1,804	202,260	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	2,790	3,680	412,658	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,070	3,768	422,451	2049/02/15
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	8,470	8,570	960,884	2022/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	550	774	86,816	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	750	1,103	123,758	2040/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	4,180	4,228	474,074	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,840	3,129	350,903	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	2,540	3,086	346,071	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	3,110	3,794	425,422	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	5,320	5,605	628,389	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	5,300	5,458	611,915	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	5,130	5,610	628,952	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,370	4,789	536,960	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	4,370	4,451	499,068	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	4,670	4,916	551,244	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,300	1,338	150,035	2024/02/29
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,550	2,708	303,681	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	3,510	3,743	419,668	2025/02/28
US T N/B 1.875 02/28/22	国債証券	1.8750	1,680	1,696	190,139	2022/02/28
US T N/B 2.5 02/15/22	国債証券	2.5000	1,070	1,092	122,530	2022/02/15
US T N/B 1.125 02/28/21	国債証券	1.1250	3,680	3,667	411,114	2021/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	4,080	4,202	471,166	2024/03/31
US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	1.7500	6,990	7,042	789,587	2022/03/31
US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	2.2500	9,760	9,842	1,103,425	2021/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	2,150	2,281	255,762	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	3,090	3,239	363,172	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	1,020	1,055	118,309	2023/03/31
US T N/B 2.25 04/30/21	国債証券	2.2500	8,170	8,244	924,346	2021/04/30
US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	1.3750	11,210	11,197	1,255,329	2021/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,760	1,858	208,397	2026/04/30

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	期		末															
									額			額	償	還	年	月	日									
									外	貨								建	金	額	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 2.75 04/30/23	国	債	証	券	2.7500	2,490				2,597		291,170													2023/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24	国	債	証	券	2.2500	3,300				3,417		383,142													2024/04/30	
US T N/B 6.25 05/15/30	国	債	証	券	6.2500	710				1,027		115,233													2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国	債	証	券	4.3750	1,300				1,859		208,492													2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国	債	証	券	4.3750	1,040				1,496		167,722													2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国	債	証	券	3.0000	980				1,171		131,360													2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国	債	証	券	4.2500	810				1,134		127,196													2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国	債	証	券	2.8750	2,720				3,188		357,493													2043/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国	債	証	券	3.3750	2,420				3,078		345,131													2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国	債	証	券	3.0000	2,500				3,007		337,162													2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国	債	証	券	3.0000	2,350				2,857		320,369													2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国	債	証	券	2.5000	2,790				3,083		345,702													2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国	債	証	券	3.1250	2,660				3,323		372,556													2048/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/22	国	債	証	券	1.7500	5,400				5,444		610,360													2022/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国	債	証	券	2.8750	3,700				4,443		498,157													2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国	債	証	券	4.5000	700				1,000		112,209													2038/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/23	国	債	証	券	1.7500	5,990				6,063		679,723													2023/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24	国	債	証	券	2.5000	6,240				6,529		731,975													2024/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/21	国	債	証	券	3.1250	8,000				8,160		914,922													2021/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国	債	証	券	2.1250	5,150				5,341		598,792													2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国	債	証	券	2.8750	4,430				4,906		550,075													2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国	債	証	券	2.3750	4,840				5,196		582,630													2029/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/27	国	債	証	券	2.3750	3,100				3,295		369,452													2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37	国	債	証	券	5.0000	500				745		83,578													2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26	国	債	証	券	1.6250	4,290				4,339		486,512													2026/05/15	
US T N/B 2.0 05/31/21	国	債	証	券	2.0000	10,130				10,197		1,143,260													2021/05/31	
US T N/B 1.625 05/31/23	国	債	証	券	1.6250	2,900				2,924		327,887													2023/05/31	
US T N/B 2.0 05/31/24	国	債	証	券	2.0000	4,770				4,893		548,635													2024/05/31	
US T N/B 2.125 05/31/26	国	債	証	券	2.1250	2,050				2,135		239,395													2026/05/31	
US T N/B 2.75 05/31/23	国	債	証	券	2.7500	3,270				3,414		382,781													2023/05/31	
US T N/B 2.875 05/31/25	国	債	証	券	2.8750	2,530				2,720		305,021													2025/05/31	
US T N/B 1.375 06/30/23	国	債	証	券	1.3750	3,460				3,462		388,233													2023/06/30	
US T N/B 2.125 06/30/22	国	債	証	券	2.1250	6,530				6,642		744,718													2022/06/30	
US T N/B 2.75 06/30/25	国	債	証	券	2.7500	790				845		94,773													2025/06/30	
US T N/B 1.875 06/30/26	国	債	証	券	1.8750	720				739		82,894													2026/06/30	
US T N/B 2.625 06/30/23	国	債	証	券	2.6250	1,820				1,895		212,472													2023/06/30	
US T N/B 1.75 06/30/24	国	債	証	券	1.7500	1,340				1,361		152,621													2024/06/30	
US T N/B 1.75 06/15/22	国	債	証	券	1.7500	830				837		93,847													2022/06/15	
US T N/B 2.875 07/31/25	国	債	証	券	2.8750	3,390				3,652		409,506													2025/07/31	
US T N/B 1.875 07/31/26	国	債	証	券	1.8750	2,370				2,434		272,903													2026/07/31	
US T N/B 1.75 07/31/24	国	債	証	券	1.7500	3,690				3,749		420,408													2024/07/31	
US T N/B 2.75 07/31/23	国	債	証	券	2.7500	3,270				3,422		383,640													2023/07/31	
US T N/B 6.25 08/15/23	国	債	証	券	6.2500	1,000				1,165		130,695													2023/08/15	
US T N/B 3.75 08/15/41	国	債	証	券	3.7500	410				544		61,058													2041/08/15	
US T N/B 5.5 08/15/28	国	債	証	券	5.5000	650				858		96,253													2028/08/15	
US T N/B 3.875 08/15/40	国	債	証	券	3.8750	1,110				1,493		167,452													2040/08/15	
US T N/B 2.75 08/15/42	国	債	証	券	2.7500	1,800				2,068		231,925													2042/08/15	
US T N/B 3.125 08/15/44	国	債	証	券	3.1250	2,830				3,465		388,483													2044/08/15	

銘柄	当	種	利	率	額	面	金	期		末			
								額	評		額		
									外			貨	建
								金	算	償			
								額	額	還			
								額	額	年			
								額	額	月			
								額	額	日			
(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	4.5000	790			1,141		127,937			2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国	債	証	3.6250	1,670			2,198		246,491			2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国	債	証	2.8750	2,090			2,464		276,266			2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国	債	証	2.0000	5,180			5,344		599,195			2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国	債	証	2.7500	770			896		100,453			2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国	債	証	2.2500	2,400			2,548		285,754			2049/08/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国	債	証	2.1250	11,000			11,108		1,245,397			2021/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国	債	証	2.5000	4,330			4,498		504,322			2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国	債	証	2.3750	6,110			6,376		714,906			2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国	債	証	2.2500	2,720			2,867		321,496			2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国	債	証	3.0000	3,210			3,927		440,366			2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国	債	証	2.2500	2,690			2,840		318,421			2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国	債	証	1.5000	4,290			4,306		482,793			2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国	債	証	2.8750	4,680			5,194		582,348			2028/08/15
US T N/B 1.625 08/15/22	国	債	証	1.6250	3,980			4,005		449,038			2022/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国	債	証	2.7500	1,640			1,757		197,046			2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国	債	証	1.6250	4,380			4,419		495,453			2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/22	国	債	証	1.8750	3,680			3,726		417,721			2022/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国	債	証	1.8750	3,120			3,188		357,434			2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国	債	証	2.7500	2,170			2,273		254,834			2023/08/31
US T N/B 1.5 08/15/22	国	債	証	1.5000	1,210			1,213		136,050			2022/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国	債	証	1.3750	1,100			1,095		122,848			2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国	債	証	1.2500	2,440			2,427		272,116			2024/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国	債	証	3.0000	1,410			1,531		171,659			2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21	国	債	証	2.1250	8,840			8,935		1,001,814			2021/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国	債	証	2.1250	2,930			3,028		339,491			2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国	債	証	1.3750	3,100			3,101		347,676			2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国	債	証	1.7500	5,250			5,300		594,279			2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国	債	証	2.8750	840			884		99,167			2023/09/30
US T N/B 1.5 09/15/22	国	債	証	1.5000	750			752		84,348			2022/09/15
US T N/B 1.5 09/30/21	国	債	証	1.5000	5,120			5,125		574,608			2021/09/30
US T N/B 3.0 10/31/25	国	債	証	3.0000	1,920			2,086		233,967			2025/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国	債	証	2.8750	3,690			3,889		436,050			2023/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国	債	証	1.6250	2,350			2,376		266,484			2026/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国	債	証	8.0000	6,000			6,673		748,202			2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国	債	証	5.2500	850			1,111		124,626			2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国	債	証	6.1250	900			1,209		135,598			2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国	債	証	3.0000	2,290			2,749		308,278			2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国	債	証	4.2500	1,110			1,567		175,716			2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国	債	証	2.7500	2,110			2,423		271,683			2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国	債	証	3.1250	760			925		103,748			2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国	債	証	3.7500	2,620			3,515		394,077			2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国	債	証	2.7500	2,640			3,074		344,689			2047/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国	債	証	3.0000	1,630			1,965		220,386			2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国	債	証	2.8750	2,220			2,633		295,258			2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国	債	証	2.2500	4,690			4,878		546,909			2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国	債	証	4.3750	410			584		65,525			2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国	債	証	3.3750	3,330			4,359		488,736			2048/11/15

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 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	3,022	338,809	2049/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	10,400	10,504	1,177,648	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,190	5,430	608,761	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	4,840	5,481	614,550	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	5,620	5,657	634,316	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	6,020	6,323	708,963	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	4,140	4,286	480,525	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	6,590	6,702	751,387	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	4,040	4,270	478,755	2027/11/15
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	3,480	3,762	421,780	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	5,640	5,951	667,274	2023/11/30
US T N/B 2.875 11/15/21	国債証券	2.8750	4,880	5,000	560,624	2021/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,400	2,448	274,445	2029/11/15
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	4,830	4,991	559,597	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,203	359,190	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,446	274,261	2025/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	9,160	9,279	1,040,325	2021/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	5,520	5,636	631,949	2022/12/31
US T N/B 2.625 12/15/21	国債証券	2.6250	3,770	3,851	431,751	2021/12/15
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	740	754	84,588	2026/12/31
小計	—	—	526,820	563,002	63,118,202	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	548	46,416	2024/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	1,160	1,171	99,128	2023/03/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	800	808	68,387	2026/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	230	335	28,371	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,100	1,519	128,577	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	720	1,101	93,205	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	870	1,347	114,029	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,600	1,676	141,799	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	880	1,293	109,452	2041/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.2500	4,700	4,801	406,168	2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	2,240	2,305	195,010	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,214	102,704	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	1,020	1,073	90,824	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,500	1,570	132,873	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	800	781	66,143	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	659	55,814	2029/06/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	600	593	50,204	2021/09/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	740	755	63,915	2023/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	800	791	66,974	2022/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	1,020	1,473	124,634	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	980	1,285	108,783	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	420	483	40,925	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	507	42,903	2064/12/01
小計	—	—	24,880	28,099	2,377,248	—
(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	870	1,138	84,513	2047/03/21

銘柄	種類	当	利率	額面金額	期		末	
					評価額			償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)								
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券		3.2500	1,520	千オーストラリア・ドル	千円	2025/04/21	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券		4.7500	1,670	千オーストラリア・ドル	千円	2027/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券		2.7500	1,980	千オーストラリア・ドル	千円	2024/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券		4.2500	2,010	千オーストラリア・ドル	千円	2026/04/21	
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券		5.5000	1,710	千オーストラリア・ドル	千円	2023/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券		3.2500	2,820	千オーストラリア・ドル	千円	2029/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券		4.5000	1,130	千オーストラリア・ドル	千円	2033/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券		3.7500	850	千オーストラリア・ドル	千円	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券		2.2500	1,740	千オーストラリア・ドル	千円	2028/05/21	
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券		2.5000	1,200	千オーストラリア・ドル	千円	2030/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券		3.2500	720	千オーストラリア・ドル	千円	2039/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券		2.7500	530	千オーストラリア・ドル	千円	2035/06/21	
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券		5.7500	1,180	千オーストラリア・ドル	千円	2022/07/15	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券		2.7500	2,080	千オーストラリア・ドル	千円	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券		2.7500	1,330	千オーストラリア・ドル	千円	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券		2.7500	1,560	千オーストラリア・ドル	千円	2029/11/21	
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券		2.2500	890	千オーストラリア・ドル	千円	2022/11/21	
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券		2.0000	1,770	千オーストラリア・ドル	千円	2021/12/21	
小計	計	-	-	27,560	32,336	2,399,708	-	
(シンガポール)								
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券		3.5000	730	千シンガポール・ドル	千円	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券		2.7500	420	千シンガポール・ドル	千円	2046/03/01	
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券		2.7500	380	千シンガポール・ドル	千円	2042/04/01	
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券		2.3750	340	千シンガポール・ドル	千円	2025/06/01	
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券		2.1250	210	千シンガポール・ドル	千円	2026/06/01	
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券		2.8750	200	千シンガポール・ドル	千円	2029/07/01	
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券		2.2500	200	千シンガポール・ドル	千円	2036/08/01	
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券		3.0000	550	千シンガポール・ドル	千円	2024/09/01	
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券		3.1250	1,600	千シンガポール・ドル	千円	2022/09/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券		2.8750	370	千シンガポール・ドル	千円	2030/09/01	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券		3.3750	480	千シンガポール・ドル	千円	2033/09/01	
小計	計	-	-	5,480	5,986	479,318	-	
(イギリス)								
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券		3.2500	1,540	千イギリス・ポンド	千円	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券		3.5000	1,280	千イギリス・ポンド	千円	2045/01/22	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券		4.0000	990	千イギリス・ポンド	千円	2060/01/22	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券		1.7500	580	千イギリス・ポンド	千円	2049/01/22	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券		5.0000	1,610	千イギリス・ポンド	千円	2025/03/07	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券		4.0000	1,040	千イギリス・ポンド	千円	2022/03/07	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券		4.2500	1,130	千イギリス・ポンド	千円	2036/03/07	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券		1.0000	820	千イギリス・ポンド	千円	2024/04/22	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券		4.2500	1,110	千イギリス・ポンド	千円	2032/06/07	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券		1.5000	1,450	千イギリス・ポンド	千円	2047/07/22	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券		3.7500	1,120	千イギリス・ポンド	千円	2052/07/22	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券		1.7500	1,020	千イギリス・ポンド	千円	2057/07/22	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券		2.5000	1,130	千イギリス・ポンド	千円	2065/07/22	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券		3.5000	890	千イギリス・ポンド	千円	2068/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券		1.5000	900	千イギリス・ポンド	千円	2026/07/22	

銘柄	種類	当	利率	額面金額	期		末	
					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 1.25 07/22/27	国債証券		1.2500	960	1,014	146,584	2027/07/22	
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券		0.5000	1,920	1,922	277,671	2022/07/22	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券		0.7500	1,560	1,575	227,575	2023/07/22	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券		4.2500	920	1,458	210,728	2039/09/07	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券		2.2500	1,180	1,254	181,220	2023/09/07	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券		2.7500	1,380	1,522	219,923	2024/09/07	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券		2.0000	790	858	124,071	2025/09/07	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券		4.5000	900	1,356	195,903	2034/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券		1.7500	1,540	1,739	251,221	2037/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券		1.7500	1,530	1,580	228,255	2022/09/07	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券		1.6250	510	603	87,188	2054/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券		1.6250	580	754	108,964	2071/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券		1.6250	1,830	2,002	289,220	2028/10/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券		0.8750	430	441	63,841	2029/10/22	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券		6.0000	760	1,118	161,619	2028/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券		4.7500	990	1,642	237,229	2038/12/07	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券		4.5000	1,080	1,842	266,174	2042/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券		4.2500	1,170	2,042	295,031	2046/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券		4.2500	1,000	1,987	287,074	2055/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券		4.2500	970	1,250	180,594	2027/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券		4.2500	960	1,545	223,177	2040/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券		4.7500	1,120	1,605	231,852	2030/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券		4.2500	990	1,802	260,337	2049/12/07	
小計	—	—	—	41,680	56,394	8,145,652	—	
(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 4.5 11/15/39	国債証券		4.5000	8,390	16,295	263,824	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券		1.7500	5,320	6,049	97,935	2025/11/15	
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券		1.5000	5,500	5,948	96,302	2023/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券		0.5000	7,130	7,706	124,761	2027/11/15	
小計	—	—	—	26,340	35,998	582,823	—	
(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	3,809	45,824	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券		1.7500	3,970	4,079	49,074	2027/02/17	
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券		3.0000	6,200	6,611	79,537	2024/03/14	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券		1.7500	3,800	3,880	46,678	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券		2.0000	2,070	2,170	26,109	2028/04/26	
小計	—	—	—	19,810	20,550	247,224	—	
(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	5,206	59,461	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券		0.7500	3,740	4,035	46,082	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券		2.5000	6,180	7,111	81,214	2025/05/12	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券		1.0000	4,250	4,623	52,795	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券		0.7500	2,170	2,349	26,836	2029/11/12	
小計	—	—	—	19,610	23,326	266,391	—	
(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	14,859	14,326	85,245	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券		8.5000	15,109	17,164	102,129	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券		7.7500	10,000	10,921	64,981	2031/05/29	

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	
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	19,118	113,752	2027/06/03
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	14,643	16,258	96,736	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	5,000	5,744	34,181	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	11,125	13,202	78,554	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	8,085	10,775	64,116	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	7,000	7,732	46,010	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	27,596	31,618	188,129	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	14,724	87,610	2023/12/07
小 計	—	—	145,488	161,587	961,447	—
(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	850	22,746	2027/03/15
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,247	33,363	2023/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,323	88,891	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	2,016	53,928	2030/04/15
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,850	2,025	54,192	2032/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,297	34,697	2033/04/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	2,570	2,669	71,418	2027/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,111	56,472	2028/06/15
MALAYSIA 4.16 07/15/21	国債証券	4.1600	4,000	4,073	108,964	2021/07/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,569	68,728	2024/07/15
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	3,000	3,050	81,596	2022/08/15
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,600	1,871	50,056	2028/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,422	64,803	2043/09/30
小 計	—	—	27,550	29,527	789,861	—
(南アフリカ)		%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	国債証券	8.0000	10,900	10,307	76,481	2030/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8.7500	10,000	8,856	65,712	2044/01/31
SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	国債証券	9.0000	4,860	4,442	32,966	2040/01/31
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8.5000	8,820	7,850	58,250	2037/01/31
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8.7500	16,040	14,065	104,363	2048/02/28
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6.5000	3,570	2,491	18,490	2041/02/28
SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	国債証券	7.7500	3,600	3,719	27,600	2023/02/28
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	7,030	6,033	44,771	2031/02/28
SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	国債証券	8.8750	8,410	7,892	58,560	2035/02/28
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8.2500	6,590	6,119	45,404	2032/03/31
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6.2500	7,460	5,363	39,800	2036/03/31
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10.5000	16,420	18,601	138,019	2026/12/21
小 計	—	—	103,700	95,743	710,419	—
(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 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	1,350	1,384	39,139	2023/01/25
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,896	53,615	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	1,900	1,990	56,265	2028/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	4,000	4,060	114,798	2022/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,361	66,765	2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,440	2,513	71,059	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,547	72,005	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,280	2,348	66,396	2027/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	1,720	1,900	53,732	2022/09/23

銘柄	柄	当期				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 4.0 10/25/23		国債証券	4.0000	3,100	3,356	94,888	2023/10/25
小計		—	—	22,900	24,360	688,666	—
(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	540	735	88,985	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31		国債証券	1.3500	210	242	29,371	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24		国債証券	3.4000	510	591	71,487	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25		国債証券	5.4000	800	1,037	125,413	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23		国債証券	3.9000	240	272	32,992	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22		国債証券	0.8000	370	380	45,966	2022/03/15
IRISH 1.5 05/15/50		国債証券	1.5000	270	336	40,687	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33		国債証券	1.3000	260	302	36,586	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30		国債証券	2.4000	690	868	105,056	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28		国債証券	0.9000	580	634	76,699	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29		国債証券	1.1000	340	380	45,955	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26		国債証券	1.0000	680	736	89,057	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37		国債証券	1.7000	320	397	48,104	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35		国債証券	0.4000	220	225	27,266	2035/05/15
IRISH 10/18/22		国債証券	0.0000	220	223	26,976	2022/10/18
小計		—	—	6,250	7,364	890,608	—
(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	960	1,755	212,343	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47		国債証券	2.7500	900	1,553	187,844	2047/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23		国債証券	3.7500	300	338	40,988	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28		国債証券	5.5000	850	1,255	151,883	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37		国債証券	4.0000	950	1,613	195,141	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33		国債証券	2.5000	910	1,234	149,258	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40		国債証券	0.5000	340	374	45,257	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/22		国債証券	0.0000	460	465	56,288	2022/01/15
NETHERLANDS 01/15/24		国債証券	0.0000	1,230	1,259	152,362	2024/01/15
NETHERLANDS 3.25 07/15/21		国債証券	3.2500	1,860	1,960	237,138	2021/07/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23		国債証券	1.7500	1,110	1,201	145,262	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26		国債証券	0.5000	940	1,001	121,097	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22		国債証券	2.2500	880	941	113,864	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24		国債証券	2.0000	820	914	110,641	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25		国債証券	0.2500	1,020	1,065	128,793	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28		国債証券	0.7500	750	825	99,771	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27		国債証券	0.7500	1,000	1,090	131,925	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29		国債証券	0.2500	790	835	101,042	2029/07/15
小計		—	—	16,070	19,688	2,380,903	—
(ユーロ…ベルギー)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/22		国債証券	4.0000	1,080	1,185	143,365	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28		国債証券	5.5000	1,240	1,832	221,578	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41		国債証券	4.2500	1,070	1,921	232,388	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26		国債証券	4.5000	790	1,031	124,724	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32		国債証券	4.0000	530	792	95,865	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35		国債証券	5.0000	1,210	2,100	254,045	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33		国債証券	1.2500	510	594	71,901	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45		国債証券	3.7500	630	1,131	136,882	2045/06/22

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	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	640	821	99,325	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	390	513	62,072	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	320	489	59,163	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	320	495	59,882	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	720	784	94,912	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	1,050	1,194	144,444	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	810	910	110,132	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	160	175	21,199	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	880	959	115,974	2028/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	610	674	81,571	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	470	669	80,915	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	590	763	92,374	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	900	961	116,295	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	650	704	85,255	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	150	181	21,917	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	240	245	29,737	2030/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.2500	1,240	1,336	161,629	2021/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	1,190	1,341	162,252	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	530	555	67,147	2024/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	660	678	82,072	2023/10/22
小計	-	-	19,580	25,047	3,029,029	-
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	2,720	2,785	336,795	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	1,270	1,302	157,570	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	1,900	1,936	234,128	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,030	1,332	161,114	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	2,800	3,489	422,036	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,270	4,233	511,908	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	960	1,994	241,217	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	790	1,732	209,548	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	2,540	3,907	472,479	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	2,850	3,076	372,075	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,650	2,823	341,495	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	1,640	2,751	332,771	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,490	2,078	251,312	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	1,560	1,973	238,667	2050/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	650	924	111,751	2066/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	1,980	2,221	268,616	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	2,770	3,543	428,519	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	2,610	2,844	344,009	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	2,290	2,712	328,057	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	2,620	2,762	334,053	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	2,190	2,344	283,550	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	1,740	2,040	246,778	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	2,070	2,193	265,246	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	1,650	1,817	219,783	2027/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	1,930	2,079	251,529	2023/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	1,990	2,340	283,029	2036/05/25

銘	柄	当				期		末								
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日	
									外	貨						建
(ユーロ…フランス)				%		千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円			
FRANCE OAT 05/25/22		国	債	証	券	0.0000	3,000		3,043		368,002			2022/05/25		
FRANCE OAT 05/25/21		国	債	証	券	0.0000	2,510		2,528		305,825			2021/05/25		
FRANCE OAT 1.75 06/25/39		国	債	証	券	1.7500	1,280		1,643		198,741			2039/06/25		
FRANCE OAT 4.25 10/25/23		国	債	証	券	4.2500	3,500		4,131		499,630			2023/10/25		
FRANCE OAT 6.0 10/25/25		国	債	証	券	6.0000	1,800		2,472		298,974			2025/10/25		
FRANCE OAT 2.75 10/25/27		国	債	証	券	2.7500	2,700		3,357		406,048			2027/10/25		
FRANCE OAT 4.0 10/25/38		国	債	証	券	4.0000	1,770		3,003		363,187			2038/10/25		
FRANCE OAT 3.25 10/25/21		国	債	証	券	3.2500	2,980		3,174		383,851			2021/10/25		
FRANCE OAT 5.75 10/25/32		国	債	証	券	5.7500	2,120		3,699		447,366			2032/10/25		
FRANCE OAT 2.25 10/25/22		国	債	証	券	2.2500	3,030		3,265		394,870			2022/10/25		
FRANCE OAT 1.75 11/25/24		国	債	証	券	1.7500	2,680		2,976		359,967			2024/11/25		
FRANCE OAT 1.0 11/25/25		国	債	証	券	1.0000	1,720		1,867		225,874			2025/11/25		
FRANCE OAT 0.25 11/25/26		国	債	証	券	0.2500	1,380		1,442		174,397			2026/11/25		
FRANCE OAT 0.75 11/25/28		国	債	証	券	0.7500	2,140		2,338		282,736			2028/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/29		国	債	証	券	0.0000	610		622		75,322			2029/11/25		
小	計	-		-			83,180		102,810		12,432,844			-		
(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		1,067		129,067			2024/01/04		
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28		国	債	証	券	5.6250	1,100		1,646		199,120			2028/01/04		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30		国	債	証	券	6.2500	710		1,192		144,230			2030/01/04		
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31		国	債	証	券	5.5000	1,240		2,059		249,010			2031/01/04		
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37		国	債	証	券	4.0000	1,500		2,590		313,214			2037/01/04		
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22		国	債	証	券	2.0000	1,650		1,732		209,565			2022/01/04		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25		国	債	証	券	0.5000	1,360		1,439		174,074			2025/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26		国	債	証	券	0.5000	1,260		1,346		162,775			2026/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29		国	債	証	券	0.2500	1,670		1,785		215,972			2029/02/15		
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23		国	債	証	券	1.5000	970		1,033		124,989			2023/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28		国	債	証	券	0.5000	1,430		1,552		187,720			2028/02/15		
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24		国	債	証	券	1.7500	1,500		1,646		199,107			2024/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27		国	債	証	券	0.2500	1,800		1,907		230,666			2027/02/15		
BUNDESOWL 04/08/22		国	債	証	券	0.0000	1,340		1,358		164,301			2022/04/08		
BUNDESOWL 04/14/23		国	債	証	券	0.0000	1,130		1,153		139,552			2023/04/14		
BUNDESOWL 04/05/24		国	債	証	券	0.0000	630		647		78,283			2024/04/05		
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24		国	債	証	券	1.5000	1,010		1,103		133,488			2024/05/15		
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23		国	債	証	券	1.5000	850		910		110,091			2023/05/15		
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27		国	債	証	券	6.5000	710		1,085		131,313			2027/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28		国	債	証	券	4.7500	600		871		105,369			2028/07/04		
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39		国	債	証	券	4.2500	840		1,570		189,868			2039/07/04		
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42		国	債	証	券	3.2500	900		1,579		191,063			2042/07/04		
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44		国	債	証	券	2.5000	1,660		2,696		326,082			2044/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40		国	債	証	券	4.7500	920		1,852		224,006			2040/07/04		
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21		国	債	証	券	3.2500	1,150		1,211		146,466			2021/07/04		
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22		国	債	証	券	1.7500	1,540		1,628		196,902			2022/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34		国	債	証	券	4.7500	1,370		2,391		289,210			2034/07/04		
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46		国	債	証	券	2.5000	1,730		2,882		348,631			2046/08/15		
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48		国	債	証	券	1.2500	1,040		1,401		169,533			2048/08/15		
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25		国	債	証	券	1.0000	670		731		88,450			2025/08/15		
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27		国	債	証	券	0.5000	1,600		1,730		209,317			2027/08/15		

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	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,710	1,778	215,069	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,440	1,536	185,855	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	1,500	1,641	198,478	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,340	1,441	174,277	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	430	449	54,383	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	330	324	39,275	2050/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	1,070	1,117	135,138	2021/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	1,650	1,741	210,627	2022/09/04
BUNDESOWL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,130	1,164	140,846	2024/10/18
BUNDESOWL 10/07/22	国債証券	0.0000	1,400	1,424	172,246	2022/10/07
BUNDESOWL 10/13/23	国債証券	0.0000	1,280	1,311	158,601	2023/10/13
小計	-	-	50,000	61,740	7,466,249	-
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	1,810	2,032	245,755	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,580	2,406	291,001	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,130	1,357	164,175	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,340	2,118	256,163	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,460	1,709	206,752	2023/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,660	1,815	219,536	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,270	1,487	179,929	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,210	1,340	162,157	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,530	1,724	208,525	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,240	1,375	166,283	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,370	1,532	185,326	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	1,570	1,599	193,380	2022/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	850	873	105,609	2030/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,170	1,620	195,948	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,170	2,084	252,032	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,070	1,891	228,758	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	760	1,330	160,940	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,370	1,729	209,141	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,650	1,941	234,775	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,220	2,027	245,212	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,140	1,422	172,021	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,540	1,703	206,047	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	490	582	70,479	2035/07/30
SPAIN 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	1,700	1,730	209,274	2021/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	340	347	42,051	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,120	1,146	138,689	2023/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	1,540	1,757	212,542	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	880	1,259	152,348	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	830	1,610	194,782	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,040	1,506	182,234	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	860	1,215	146,998	2048/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,580	1,786	216,081	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,480	1,641	198,521	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,070	1,167	141,229	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,080	1,123	135,865	2029/10/31

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…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	1,430	1,679	203,140	2023/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	1,340	1,371	165,872	2022/10/31
小 計	—	—	45,890	57,054	6,899,589	—
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,280	1,978	239,244	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	970	1,338	161,865	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,390	1,532	185,297	2028/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,020	1,211	146,562	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,020	1,377	166,608	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,090	1,280	154,875	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	660	794	96,095	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,790	2,209	267,250	2025/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	1,700	1,877	227,105	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,630	2,023	244,660	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	640	681	82,416	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	520	649	78,546	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	970	1,233	149,193	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,640	2,047	247,556	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	1,070	1,101	133,160	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	920	946	114,448	2023/03/01
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	1,660	1,712	207,105	2022/04/15
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	770	792	95,779	2022/04/01
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,040	1,084	131,121	2030/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,000	3,050	368,909	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,599	193,423	2023/05/01
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	国債証券	3.7500	2,300	2,409	291,434	2021/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	1,610	1,723	208,462	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,540	1,629	197,066	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,500	1,606	194,274	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,690	1,793	216,838	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	520	578	69,976	2027/06/01
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	国債証券	0.4500	910	918	111,049	2021/06/01
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	130	143	17,312	2026/07/15
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	3,200	3,383	409,145	2021/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,610	2,397	289,923	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,330	2,091	252,883	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,207	266,897	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,600	1,764	213,360	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	780	932	112,826	2029/08/01
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	980	1,004	121,450	2022/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	940	1,146	138,591	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	970	1,540	186,262	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	990	1,288	155,851	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	750	998	120,709	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,440	2,274	275,070	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	700	786	95,096	2050/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.7500	2,470	2,657	321,427	2021/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,100	1,269	153,514	2033/09/01

銘	柄	当				期		末									
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日		
									外	貨						建	金
(ユーロ…イタリア)					%	千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円				
ITALY	BTPS	3.75	09/01/24	国	債	証	券	3.7500	1,900	2,201	266,175						2024/09/01
ITALY	BTPS	3.85	09/01/49	国	債	証	券	3.8500	740	1,066	128,979						2049/09/01
ITALY	BTPS	5.5	09/01/22	国	債	証	券	5.5000	1,150	1,311	158,652						2022/09/01
ITALY	BTPS	2.25	09/01/36	国	債	証	券	2.2500	1,020	1,147	138,767						2036/09/01
ITALY	BTPS	1.45	09/15/22	国	債	証	券	1.4500	1,500	1,559	188,540						2022/09/15
ITALY	BTPS	0.65	10/15/23	国	債	証	券	0.6500	980	1,001	121,096						2023/10/15
ITALY	BTPS	9.0	11/01/23	国	債	証	券	9.0000	1,190	1,580	191,151						2023/11/01
ITALY	BTPS	7.25	11/01/26	国	債	証	券	7.2500	1,080	1,556	188,214						2026/11/01
ITALY	BTPS	6.5	11/01/27	国	債	証	券	6.5000	1,790	2,568	310,648						2027/11/01
ITALY	BTPS	5.25	11/01/29	国	債	証	券	5.2500	2,030	2,854	345,155						2029/11/01
ITALY	BTPS	5.5	11/01/22	国	債	証	券	5.5000	1,960	2,253	272,494						2022/11/01
ITALY	BTPS	1.45	11/15/24	国	債	証	券	1.4500	1,040	1,099	132,941						2024/11/15
ITALY	BTPS	2.5	11/15/25	国	債	証	券	2.5000	550	615	74,385						2025/11/15
ITALY	BTPS	0.35	11/01/21	国	債	証	券	0.3500	1,700	1,716	207,544						2021/11/01
ITALY	BTPS	2.0	12/01/25	国	債	証	券	2.0000	970	1,058	128,015						2025/12/01
ITALY	BTPS	1.25	12/01/26	国	債	証	券	1.2500	1,350	1,415	171,157						2026/12/01
ITALY	BTPS	2.5	12/01/24	国	債	証	券	2.5000	970	1,073	129,785						2024/12/01
ITALY	BTPS	2.8	12/01/28	国	債	証	券	2.8000	1,400	1,640	198,340						2028/12/01
ITALY	BTPS	2.15	12/15/21	国	債	証	券	2.1500	1,680	1,751	211,796						2021/12/15
小	計	-	-	-	-	-	-	-	81,140	96,539	11,674,496						-
(ユーロ…フィンランド)					%	千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円				
FINLAND	2.0	04/15/24	国	債	証	券	2.0000	280	310	37,537							2024/04/15
FINLAND	0.75	04/15/31	国	債	証	券	0.7500	380	419	50,722							2031/04/15
FINLAND	1.375	04/15/47	国	債	証	券	1.3750	130	169	20,476							2047/04/15
FINLAND	0.5	04/15/26	国	債	証	券	0.5000	300	317	38,438							2026/04/15
FINLAND	1.125	04/15/34	国	債	証	券	1.1250	230	267	32,369							2034/04/15
FINLAND	1.5	04/15/23	国	債	証	券	1.5000	170	181	21,932							2023/04/15
FINLAND	04/15/22	国	債	証	券	0.0000	320	324	39,228								2022/04/15
FINLAND	4.0	07/04/25	国	債	証	券	4.0000	430	536	64,824							2025/07/04
FINLAND	2.75	07/04/28	国	債	証	券	2.7500	380	479	58,015							2028/07/04
FINLAND	2.625	07/04/42	国	債	証	券	2.6250	350	541	65,528							2042/07/04
FINLAND	0.5	09/15/29	国	債	証	券	0.5000	270	289	35,043							2029/09/15
FINLAND	0.875	09/15/25	国	債	証	券	0.8750	300	323	39,082							2025/09/15
FINLAND	0.5	09/15/28	国	債	証	券	0.5000	240	257	31,089							2028/09/15
FINLAND	0.5	09/15/27	国	債	証	券	0.5000	300	320	38,704							2027/09/15
FINLAND	1.625	09/15/22	国	債	証	券	1.6250	400	423	51,178							2022/09/15
FINLAND	09/15/23	国	債	証	券	0.0000	230	235	28,422								2023/09/15
小	計	-	-	-	-	-	-	-	4,710	5,396	652,595						-
(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	250	571	69,171							2062/01/26
AUSTRIA	1.5	02/20/47	国	債	証	券	1.5000	370	485	58,758							2047/02/20
AUSTRIA	0.5	02/20/29	国	債	証	券	0.5000	340	364	44,050							2029/02/20
AUSTRIA	0.75	02/20/28	国	債	証	券	0.7500	820	892	107,980							2028/02/20
AUSTRIA	4.85	03/15/26	国	債	証	券	4.8500	590	782	94,684							2026/03/15
AUSTRIA	4.15	03/15/37	国	債	証	券	4.1500	890	1,509	182,536							2037/03/15
AUSTRIA	3.65	04/20/22	国	債	証	券	3.6500	280	305	36,999							2022/04/20
AUSTRIA	0.5	04/20/27	国	債	証	券	0.5000	520	553	66,980							2027/04/20
AUSTRIA	2.4	05/23/34	国	債	証	券	2.4000	480	645	78,117							2034/05/23

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	460	781	94,447	2044/06/20	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	670	1,004	121,476	2027/07/15	
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	350	357	43,178	2023/07/15	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	1,420	1,511	182,745	2021/09/15	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	330	643	77,778	2117/09/20	
AUSTRIA 09/20/22	国債証券	0.0000	470	477	57,767	2022/09/20	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	540	596	72,076	2024/10/21	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	580	625	75,686	2026/10/20	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	640	701	84,885	2025/10/20	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	750	815	98,569	2023/10/20	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	180	262	31,776	2086/11/02	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	740	822	99,484	2022/11/22	
小	計	—	—	11,670	14,712	1,779,149	—
合	計	—	—	—	—	127,972,430	—

■投資信託財産の構成

2020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	127,972,430		97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,017,425		2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	130,989,855		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、130,489,048千円、99.6％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、2020年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.11円、1カナダ・ドル=84.60円、1オーストラリア・ドル=74.21円、1シンガポール・ドル=80.07円、1イギリス・ポンド=144.44円、1デンマーク・クローネ=16.19円、1ノルウェー・クローネ=12.03円、1スウェーデン・クローナ=11.42円、1メキシコ・ペソ=5.95円、1マレーシア・リンギット=26.75円、1南アフリカ・ランド=7.42円、1ポーランド・ズロチ=28.27円、1ユーロ=120.93円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	130,989,855,521円
コ ー ル ・ ク ー ン 等	2,138,894,536
公 社 債(評価額)	127,972,430,109
未 収 利 息	869,632,019
前 払 費 用	8,898,857
(B) 負 債	185,938,200
未 払 解 約 金	185,938,200
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	130,803,917,321
元 本	66,784,593,799
次 期 繰 越 損 益	64,019,323,522
(D) 受 益 権 総 口 数	66,784,593,799口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	19,586円

(注1) 期首元本額	108,789,722,301円
追加設定元本額	14,409,786,591円
一部解約元本額	56,414,915,093円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I A M 外国債券パッシブ・ファンド	8,874,003,827円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	5,775,654円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	22,123,281円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	25,741,467円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	80,085,833円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	83,655,608円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	35,465,308円
たわらノーロード 先進国債券	6,509,607,053円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	149,495,926円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	479,712,374円
たわらノーロード バランス (堅実型)	11,707,903円
たわらノーロード バランス (標準型)	55,613,057円
たわらノーロード バランス (積極型)	11,564,861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)	1,913,072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)	134,211,407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)	176,522,766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)	60,240,852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)	36,378,986円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	68,332円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,616,898円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	4,040,132円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,282,053円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,349,638円
D I A M 外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,832,006,477円
One DC 先進国債券インデックスファンド	639,979円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型	585,714,796円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	1,821,374,172円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型	1,899,253,523円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	367,533,477円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	797,283,999円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	632,041,626円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	20,946,445円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	607,750,277円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	22,230,425円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	125,271,635円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	89,691,387円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	147,541,325円
クルーズコントロール	1,255,331,264円

D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	109,167,362円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	177,161,233円
クルーズコントロール<DC年金>	1,269,534円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	1,786,439円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	7,504,090円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	38,912,796円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	120,359,994円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	139,662円
D I A M パッシブ資産分散ファンド	1,165,889,077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)	818,056円
D I A M 指替フルヘルプ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	6,588,503,236円
D I A M 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	3,322,079,347円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,199,859,662円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	6,073,392,201円
D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	71,552,724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)	255,255円
D I A M グローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	606,183,336円
D I A M グローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	455,700,977円
D I A M 国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	42,453,454円
D I A M 国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	68,261,200円
D I A M 国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	19,577,030円
D I A M 国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	5,136,190円
D I A M 世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	55,431,781円
D I A M 世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	76,799,804円
D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,762,682,039円
D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,924,647,331円
D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,376,447,915円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	604,894,639円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	234,213,008円
D I A M 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)	2,604,999,197円
D I A M 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家向け)	639,500,550円
D I A M 世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	4,781,172円
D I A M 世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	91,625,774円
D I A M 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	449,766,733円
D I A M 世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	644,060,493円
D I A M 世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	1,151,182,638円
D I A M 世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	73,750,748円
D I A M バランス20VA (適格機関投資家限定)	44,525,537円
D I A M バランス40VA (適格機関投資家限定)	364,076円
D I A M バランス60VA (適格機関投資家限定)	170,414円
期末元本合計	66,784,593,799円

■損益の状況

当期 自2019年2月22日 至2020年2月21日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		3,956,180,646円
受 取 利 息		3,956,709,728
支 払 利 息		△529,082
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		7,416,281,605
売 買 益		12,399,227,471
売 買 損		△4,982,945,866
(C) そ の 他 費 用		△19,454,538
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		11,353,007,713
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		88,880,284,980
(F) 解 約 差 損 益 金		△48,712,391,980
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		12,498,422,809
(H) 合 計(D + E + F + G)		64,019,323,522
次 期 繰 越 損 益 金(H)		64,019,323,522

(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。