

運用報告書 (全体版)

第3期<決算日2019年10月15日>

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>

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	2016年10月3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、為替ヘッジあり) 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	たわらノーロード 先進国債券 <為替ヘッジあり>
	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マザーファンド
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フルヘッジを行います。
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。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却益 (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<為替ヘッジあり>」は、2019年10月15日に第3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/>

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>

■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、 為替ヘッジあり) (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			
(設定日) 2016年10月3日	円 10,000	円 -	% -	ポイント (9月30日) 398.82	% -	% -	% -	百万円 1
1期 (2017年10月12日)	9,619	0	△3.8	383.88	△3.7	97.7	-	1,294
2期 (2018年10月12日)	9,380	0	△2.5	375.63	△2.1	98.3	-	2,915
3期 (2019年10月15日)	10,203	0	8.8	410.49	9.3	98.7	-	5,626

(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、為替ヘッジあり) です (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、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)		債券組入 率	債券先物 率
	円	騰 落 率	ポイ ント	騰 落 率		
(期 首) 2018 年 10 月 12 日	9,380	% -	ポイ ント 375.63	% -	% 98.3	% -
10 月 末	9,432	0.6	377.76	0.6	94.7	-
11 月 末	9,460	0.9	378.89	0.9	97.8	-
12 月 末	9,587	2.2	384.13	2.3	94.4	-
2019 年 1 月 末	9,627	2.6	385.88	2.7	95.9	-
2 月 末	9,615	2.5	385.50	2.6	98.6	-
3 月 末	9,789	4.4	392.62	4.5	95.5	-
4 月 末	9,720	3.6	389.98	3.8	97.8	-
5 月 末	9,852	5.0	395.72	5.3	94.8	-
6 月 末	10,007	6.7	401.98	7.0	97.6	-
7 月 末	10,049	7.1	403.79	7.5	96.8	-
8 月 末	10,359	10.4	416.34	10.8	95.2	-
9 月 末	10,280	9.6	413.28	10.0	97.4	-
(期 末) 2019 年 10 月 15 日	10,203	8.8	410.49	9.3	98.7	-

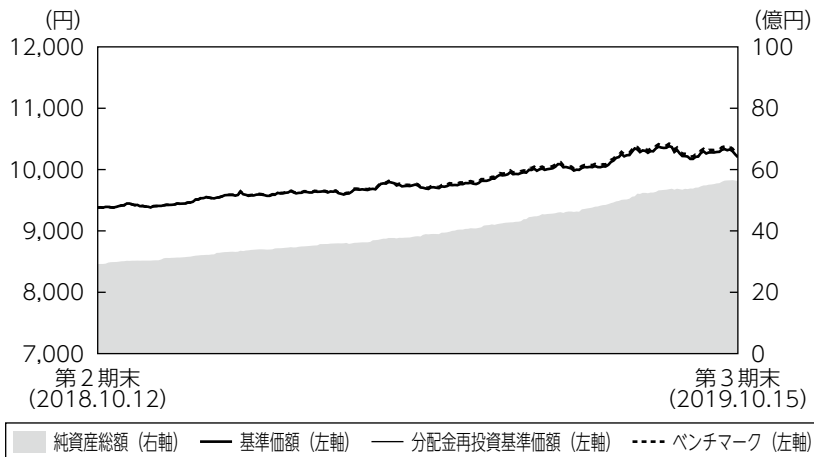
(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2018年10月13日から2019年10月15日まで）

基準価額等の推移



第3期首： 9,380円
第3期末： 10,203円
(既払分配金0円)
騰落率： 8.8%
(分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

米国では世界的な景気減速に加え、米中貿易摩擦の激化やブレグジット（英国のEU離脱）等の不透明感があり、FRB（米連邦準備理事会）が政策金利の引き下げを実施したことなどから、米国債利回りは低下（価格は上昇）しました。欧州圏ではECB（欧州中央銀行）が追加金融緩和を決定したことなどから、欧州債の利回りは低下しました。これらがプラスに寄与し、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、欧州債の利回りは、ともに低下（価格は上昇）しました。米国では世界的な景気減速に加え、米中貿易摩擦の激化やブレグジット等の不透明感があり、F R Bが政策金利の引き下げを実施したことなどから、米国債利回りは低下しました。欧州圏ではE C Bが追加金融緩和を決定したことなどから、欧州債の利回りは低下しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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。

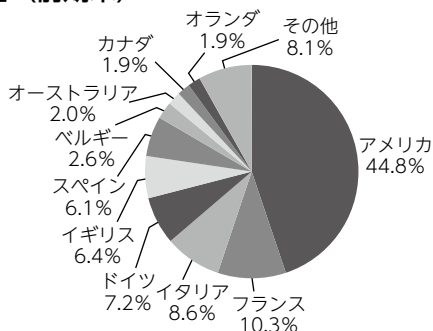
●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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、為替ヘッジあり）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。また、組入外貨建資産に対して対円での為替フルヘッジを行いました。

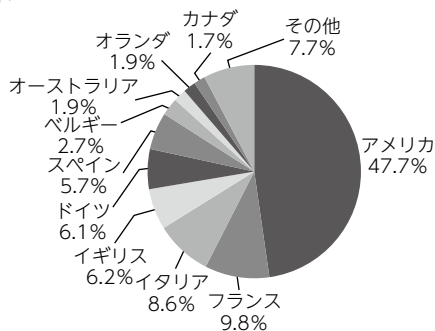
【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○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。

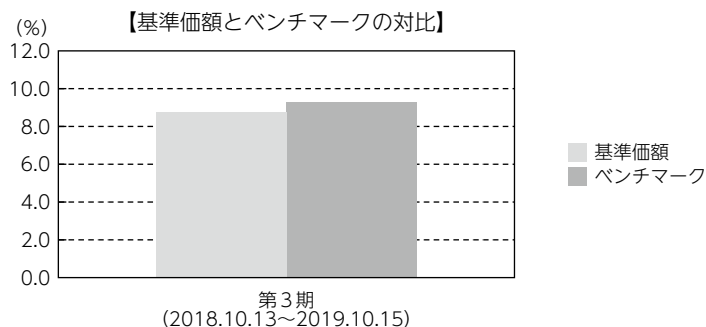
(注3) 上位11位以下をその他に含めて集計しています。

(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9.3%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
	2018年10月13日 ～2019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	608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、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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。また、組入外貨建資産に対して対円での為替フルヘッジを行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第3期		項目の概要
	(2018年10月13日 ～2019年10月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	21円	0.218%	(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9,811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)	(9)	(0.095)	
(販売会社)	(9)	(0.095)	
(受託会社)	(3)	(0.027)	
(b) その他費用	1	0.013	(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)	(1)	(0.009)	
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	23	0.231	

(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。

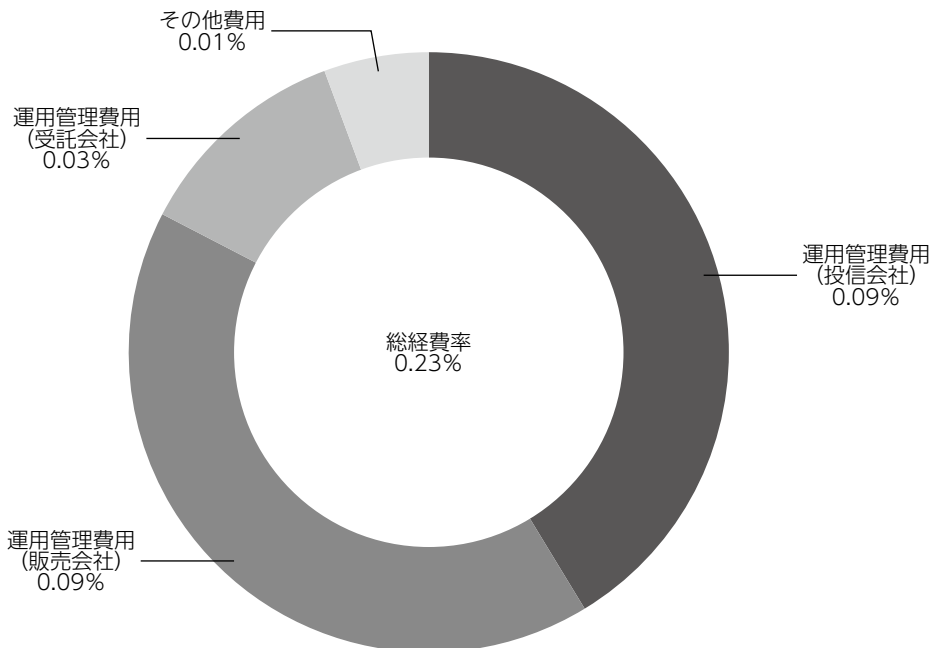
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.23%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（2018年10月13日から2019年10月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,814,893	2,497,957	91,783	125,544

■利害関係人との取引状況等（2018年10月13日から2019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
	千□	千□	千円
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,236,676	3,959,786	5,626,065

■投資信託財産の構成

2019年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,626,065	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	16,319	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	5,642,384	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、2019年10月15日現在、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは462,748,718千円、99.2%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、2019年10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.42円、1カナダ・ドル=81.96円、1オーストラリア・ドル=73.42円、1シンガポール・ドル=79.23円、1イギリス・ポンド=136.63円、1デンマーク・クローネ=16.01円、1ノルウェー・クローネ=11.91円、1スウェーデン・クローナ=11.04円、1メキシコ・ペソ=5.63円、1マレーシア・リングギット=25.89円、1南アフリカ・ランド=7.32円、1ポーランド・ズロチ=27.82円、1ユーロ=119.53円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年10月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,642,384,277円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	16,319,047
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド(評価額)	5,626,065,230
(B) 負 債	15,787,155
未 払 解 約 金	10,509,717
未 払 信 託 報 酬	5,186,254
そ の 他 未 払 費 用	91,184
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,626,597,122
元 本	5,514,416,355
次 期 繰 越 損 益 金	112,180,767
(D) 受 益 権 総 口 数	5,514,416,355口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,203円

(注) 期首における元本額は3,107,875,830円、当期中における追加設定元本額は3,641,511,774円、同解約元本額は1,234,971,249円です。

■損益の状況

当期 自2018年10月13日 至2019年10月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△7,798円
受 取 利 息	1,087
支 払 利 息	△8,885
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	289,095,537
売 買 損 益	338,591,384
買 買 損 益	△49,495,847
(C) 信 託 報 酬 等	△8,961,503
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	280,126,236
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△47,838,084
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△120,107,385
(配 当 等 相 当 額)	(99,794,105)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△219,901,490)
(G) 合 計(D+E+F)	112,180,767
次 期 繰 越 損 益 金(G)	112,180,767
追 加 信 託 差 損 益 金	△120,107,385
(配 当 等 相 当 額)	(103,372,376)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△223,479,761)
分 配 準 備 積 立 金	232,288,152

(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	89,497,013円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	102,546,814
(c) 収 益 調 整 金	103,372,376
(d) 分 配 準 備 積 立 金	40,244,325
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	335,660,528
(f) 1万口当たり当期分配対象額	608.70
(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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第12期（決算日 2019年6月24日）

（計算期間 2018年6月23日～2019年6月24日）

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第12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	2008年1月16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、為替ヘッジあり）」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割合には、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	純資産総額
	円	騰落率	(除く日本、円ベース、為替ヘッジあり) (ベンチマーク)	騰落率			
8期 (2015年6月22日)	12,930	4.1	371.27	4.2	98.1	-	179,224
9期 (2016年6月22日)	13,626	5.4	391.61	5.5	92.9	-	164,686
10期 (2017年6月22日)	13,477	△1.1	387.96	△0.9	97.9	-	177,029
11期 (2018年6月22日)	13,246	△1.7	381.67	△1.6	98.0	-	290,732
12期 (2019年6月24日)	13,888	4.8	400.89	5.0	96.9	-	454,858

(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、為替ヘッジあり）です（以下同じ）。

(注3) FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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

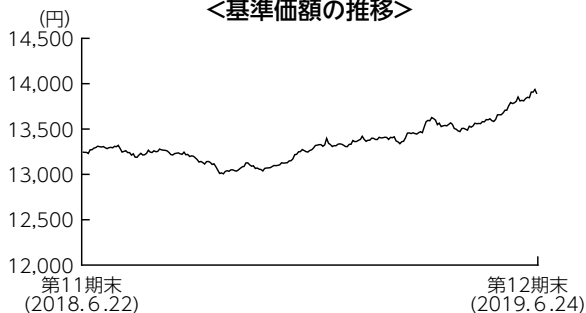
年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債 イ ン デ ッ ク ス		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率		(除く日本、 円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2018 年 6 月 22 日	円 13,246	% -	ポイント 381.67	% -	% 98.0	% -
6 月 末	13,272	0.2	382.43	0.2	97.5	-
7 月 末	13,212	△0.3	380.68	△0.3	97.5	-
8 月 末	13,229	△0.1	381.23	△0.1	94.5	-
9 月 末	13,142	△0.8	378.76	△0.8	99.6	-
10 月 末	13,106	△1.1	377.76	△1.0	94.7	-
11 月 末	13,148	△0.7	378.89	△0.7	97.8	-
12 月 末	13,326	0.6	384.13	0.6	94.4	-
2019 年 1 月 末	13,385	1.0	385.88	1.1	95.9	-
2 月 末	13,370	0.9	385.50	1.0	98.6	-
3 月 末	13,615	2.8	392.62	2.9	95.5	-
4 月 末	13,521	2.1	389.98	2.2	97.8	-
5 月 末	13,708	3.5	395.72	3.7	94.8	-
(期 末) 2019 年 6 月 24 日	13,888	4.8	400.89	5.0	96.9	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過 (2018年6月23日から2019年6月24日まで)

<基準価額の推移>



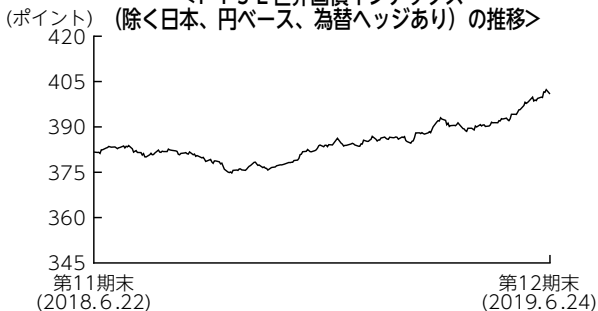
基準価額の推移

基準価額は13,888円となり、前期末比で4.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

世界的な景気減速を背景に、F R B (米連邦準備理事会) が政策金利を引き下げる可能性が高まり、米国債利回りが低下 (価格は上昇) したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

<FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジあり) の推移>



投資環境

外国債券市場では、米国債利回り、欧州債利回り、ともに低下しました。米国では世界的な景気減速に加え、米中貿易摩擦やブレグジット (英国のEU離脱) 等の不透明感があることから、F R B が政策金利を引き下げる可能性が高まり、米国債利回りは低下しました。欧州圏ではE C B (欧州中央銀行) が経済見通しを下方修正したことなどから、欧州債利回りは低下しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジあり) 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。

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5.0%上昇しました。当ファンドはベンチマークを0.2%下回りましたが、債券時価の採用基準が異なることを除くと、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	
	金 額	比 率
(a) その他費用 (保管費用)	1円	0.011%
(その他)	(0)	(0.000)
合 計	1	0.011

(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(13,344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 (2018年6月23日から2019年6月24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 1,727,124	千アメリカ・ドル 996,219 (-)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 95,579	千カナダ・ドル 64,817 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 92,690	千オーストラリア・ドル 54,222 (-)
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 11,840	千シンガポール・ドル 4,460 (-)
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 172,380	千イギリス・ポンド 113,940 (-)
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 76,449	千デンマーク・クローネ 58,854 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 30,963	千ノルウェー・クローネ 20,731 (-)
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 60,428	千スウェーデン・クローナ 30,099 (-)
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 517,862	千メキシコ・ペソ 308,612 (-)
	マレーシア	国 債 証 券	千マレーシア・リングgit 11,009	千マレーシア・リングgit 11,734 (-)
南アフリカ	国 債 証 券	千南アフリカ・ランド 248,200	千南アフリカ・ランド 179,348 (-)	

			買 付 額	売 付 額
外 国	ユ ー ロ	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 国債証券 63,945	千ポーランド・ズロチ 27,822 (-)
		アイルランド	千ユーロ 国債証券 38,864	千ユーロ 24,283 (-)
		オランダ	国債証券 76,616	44,422 (-)
		ベルギー	国債証券 80,521	46,009 (-)
		フランス	国債証券 274,219	161,227 (-)
		ドイツ	国債証券 154,501	84,783 (-)
		スペイン	国債証券 157,094	84,462 (-)
		イタリア	国債証券 207,405	132,875 (-)
		フィンランド	国債証券 40,102	23,587 (-)
		オーストリア	国債証券 61,086	41,115 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2018年6月23日から2019年6月24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BB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 1,897,040	千アメリカ・ドル 1,959,720	千円 210,513,189	% 46.3	% -	% 19.4	% 18.2	% 8.7	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 96,660	千カナダ・ドル 105,900	千円 8,619,241	1.9	-	0.9	0.6	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 103,840	千オーストラリア・ドル 119,687	千円 8,943,082	2.0	-	1.3	0.5	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 18,890	千シンガポール・ドル 19,773	千円 1,569,259	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 157,630	千イギリス・ポンド 202,660	千円 27,752,388	6.1	-	4.8	1.0	0.4	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 82,950	千デンマーク・クローネ 112,323	千円 1,838,735	0.4	-	0.3	0.1	-	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 58,270	千ノルウェー・クローネ 60,483	千円 765,110	0.2	-	0.1	0.1	-	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 93,620	千スウェーデン・クローナ 108,322	千円 1,245,710	0.3	-	0.2	0.1	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 583,851	千メキシコ・ペソ 594,064	千円 3,344,583	0.7	-	0.5	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リングギット 41,940	千マレーシア・リングギット 43,482	千円 1,127,076	0.2	-	0.2	0.1	-	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 292,370	千南アフリカ・ランド 269,204	千円 2,019,032	0.4	-	0.4	0.0	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 91,990	千ポーランド・ズロチ 96,120	千円 2,762,493	0.6	-	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	30,170	34,335	4,197,194	0.9	-	0.5	0.3	0.1	
オランダ	68,190	81,211	9,927,255	2.2	-	1.2	0.8	0.1	
ベルギー	76,370	95,276	11,646,643	2.6	-	1.7	0.7	0.1	
フランス	291,320	355,190	43,418,518	9.5	-	6.7	2.2	0.7	
ドイツ	190,530	232,138	28,376,636	6.2	-	3.6	2.0	0.6	
スペイン	175,120	212,916	26,026,971	5.7	-	4.1	1.2	0.4	
イタリア	264,820	293,577	35,886,879	7.9	-	5.3	2.1	0.5	
フィンランド	29,480	31,928	3,902,995	0.9	-	0.3	0.4	0.2	
オーストリア	48,530	57,967	7,085,945	1.6	-	1.0	0.5	0.1	
合 計	-	-	千円 440,968,947	96.9	-	52.9	31.4	12.7	

(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 償還年月日
	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	8,050	8,400	902,424	2026/01/31	
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	2,980	3,081	330,963	2025/01/31	
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	3,780	3,852	413,847	2024/01/31	
US T N/B 1.375 01/31/21	国債証券	1.3750	6,760	6,710	720,821	2021/01/31	
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	8,180	8,172	877,869	2023/01/31	
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	10,750	11,082	1,190,481	2024/01/31	
US T N/B 1.875 01/31/22	国債証券	1.8750	6,840	6,857	736,641	2022/01/31	
US T N/B 2.5 01/31/21	国債証券	2.5000	17,950	18,135	1,948,145	2021/01/31	
US T N/B 2.5 01/15/22	国債証券	2.5000	14,320	14,581	1,566,312	2022/01/15	
US T N/B 2.375 01/31/23	国債証券	2.3750	2,760	2,817	302,616	2023/01/31	
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	800	1,002	107,738	2026/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	2,760	3,055	328,232	2042/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	6,130	6,765	726,802	2043/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	10,100	9,935	1,067,311	2046/02/15	
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	2,150	2,533	272,198	2039/02/15	
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	830	1,060	113,962	2029/02/15	
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	2,300	3,071	329,966	2031/02/15	
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	2,180	2,858	307,006	2036/02/15	
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	4,420	6,133	658,851	2041/02/15	
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	7,940	9,496	1,020,162	2044/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	11,190	12,128	1,302,880	2049/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	10,000	10,060	1,080,741	2022/02/15	
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	1,210	1,588	170,626	2038/02/15	
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	5,110	6,960	747,678	2040/02/15	
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	11,830	11,617	1,247,942	2026/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	10,160	10,005	1,074,841	2045/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	12,980	14,071	1,511,517	2047/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	8,610	9,308	999,885	2048/02/15	
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	11,930	12,429	1,335,177	2024/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	21,670	21,823	2,344,318	2025/02/15	
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	21,640	22,690	2,437,426	2029/02/15	
US T N/B 1.75 02/28/22	国債証券	1.7500	10,500	10,496	1,127,549	2022/02/28	
US T N/B 3.625 02/15/21	国債証券	3.6250	7,430	7,647	821,475	2021/02/15	
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	14,940	15,804	1,697,695	2028/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	14,000	14,108	1,515,504	2023/02/15	
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	15,070	15,385	1,652,701	2027/02/15	
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	3,330	3,376	362,680	2024/02/29	
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	5,520	5,720	614,494	2026/02/28	
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	6,290	6,588	707,712	2025/02/28	
US T N/B 1.875 02/28/22	国債証券	1.8750	2,440	2,446	262,841	2022/02/28	
US T N/B 2.5 02/15/22	国債証券	2.5000	7,160	7,295	783,632	2022/02/15	
US T N/B 2.375 02/29/24	国債証券	2.3750	5,800	5,949	639,048	2024/02/29	
US T N/B 1.125 02/28/21	国債証券	1.1250	1,740	1,719	184,733	2021/02/28	
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	12,400	12,770	1,371,755	2023/02/28	
US T N/B 2.5 02/28/21	国債証券	2.5000	15,690	15,864	1,704,178	2021/02/28	
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	20,250	20,534	2,205,839	2024/03/31	
US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	1.7500	5,290	5,288	568,069	2022/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	2.2500	11,920	12,010	1,290,190	2021/03/31	
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	29,280	28,980	3,113,050	2023/03/31	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	2,400	2,498	268,360	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	9,450	9,646	1,036,213	2026/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/21	国債証券	1.2500	12,310	12,189	1,309,420	2021/03/31	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	6,720	6,894	740,580		2023/03/31
US T N/B 1.875 03/31/22	国債証券	1.8750	13,300	13,344	1,433,472		2022/03/31
US T N/B 2.375 03/15/22	国債証券	2.3750	15,120	15,374	1,651,525		2022/03/15
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	4,220	4,453	478,421		2025/04/30
US T N/B 2.25 04/30/21	国債証券	2.2500	8,490	8,559	919,510		2021/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	14,260	14,378	1,544,492		2024/04/30
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	9,800	9,743	1,046,620		2023/04/30
US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	1.3750	10,000	9,921	1,065,799		2021/04/30
US T N/B 1.875 04/30/22	国債証券	1.8750	10,390	10,424	1,119,754		2022/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	8,680	8,929	959,212		2026/04/30
US T N/B 2.25 04/15/22	国債証券	2.2500	22,820	23,125	2,484,147		2022/04/15
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	10,670	11,049	1,186,906		2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	11,660	11,894	1,277,755		2024/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	1,210	1,698	182,436		2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	4,250	5,613	603,014		2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	2,100	2,779	298,614		2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	2,310	2,504	269,018		2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	5,170	6,710	720,881		2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	13,140	13,902	1,493,422		2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	10,700	12,302	1,321,527		2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	8,570	9,266	995,451		2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	6,660	7,212	774,768		2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	8,840	8,690	933,563		2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	8,270	9,159	983,862		2048/05/15
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	1,250	1,249	134,232		2022/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,680	3,896	418,589		2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	2,250	3,001	322,416		2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	34,530	34,481	3,703,982		2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	10,790	11,135	1,196,186		2024/05/15
US T N/B 3.125 05/15/21	国債証券	3.1250	100	102	11,006		2021/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	12,390	12,558	1,349,021		2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	13,610	14,538	1,561,752		2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	6,270	6,443	692,200		2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	19,970	20,548	2,207,344		2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	890	1,246	133,912		2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	14,030	13,754	1,477,548		2026/05/15
US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	2.0000	11,560	11,606	1,246,767		2021/05/31
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	1,460	1,451	155,950		2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	3,500	3,532	379,432		2024/05/31
US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	1.7500	9,490	9,487	1,019,171		2022/05/31
US T N/B 2.125 05/15/22	国債証券	2.1250	12,700	12,832	1,378,449		2022/05/15
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,880	4,020	431,927		2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	4,550	4,804	516,136		2025/05/31
US T N/B 1.375 05/31/21	国債証券	1.3750	12,350	12,253	1,316,262		2021/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	550	540	58,106		2023/06/30
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	7,540	7,604	816,839		2024/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	3,820	3,860	414,735		2022/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	8,100	8,496	912,719		2025/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	2,650	2,735	293,846		2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/22	国債証券	1.7500	5,160	5,160	554,326		2022/06/30
US T N/B 1.125 06/30/21	国債証券	1.1250	10,000	9,874	1,060,686		2021/06/30
US T N/B 2.625 06/15/21	国債証券	2.6250	16,260	16,529	1,775,643		2021/06/15
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	3,520	3,570	383,551		2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	8,400	8,222	883,216		2023/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	21,300	22,514	2,418,533		2025/07/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル		千円	
US T N/B 1.125 07/31/21	国債証券	1.1250	13,900	13,715		1,473,294	2021/07/31
US T N/B 1.875 07/31/22	国債証券	1.8750	10,290	10,323		1,108,977	2022/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	10,070	10,448		1,122,359	2023/07/31
US T N/B 2.625 07/15/21	国債証券	2.6250	16,670	16,955		1,821,312	2021/07/15
US T N/B 2.625 07/31/20	国債証券	2.6250	24,300	24,481		2,629,778	2020/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,200	1,412		151,743	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	4,490	5,463		586,838	2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	930	1,197		128,652	2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	5,580	6,910		742,319	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	3,830	3,977		427,229	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	8,090	8,928		959,050	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	2,000	2,680		287,969	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	8,930	10,669		1,146,162	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	7,640	8,073		867,295	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	11,600	11,670		1,253,660	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	7,440	7,672		824,179	2047/08/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.1250	9,590	9,660		1,037,760	2021/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	6,700	6,888		740,009	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	12,610	12,945		1,390,651	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	12,910	12,043		1,293,724	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	10,310	11,158		1,198,603	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	12,780	13,024		1,399,048	2027/08/15
US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	2.6250	13,350	13,457		1,445,644	2020/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	12,080	11,726		1,259,612	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	14,020	14,984		1,609,613	2028/08/15
US T N/B 2.0 08/31/21	国債証券	2.0000	7,060	7,094		762,055	2021/08/31
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	8,140	8,542		917,637	2025/08/31
US T N/B 2.125 08/31/20	国債証券	2.1250	11,660	11,690		1,255,786	2020/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	9,500	9,341		1,003,498	2023/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	7,320	7,336		788,091	2024/08/31
US T N/B 1.125 08/31/21	国債証券	1.1250	11,000	10,849		1,165,455	2021/08/31
US T N/B 1.375 08/31/20	国債証券	1.3750	25,320	25,162		2,702,956	2020/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	7,030	7,299		784,070	2023/08/31
US T N/B 1.5 08/15/20	国債証券	1.5000	22,880	22,773		2,446,340	2020/08/15
US T N/B 2.625 08/31/20	国債証券	2.6250	12,790	12,897		1,385,483	2020/08/31
US T N/B 1.625 08/31/22	国債証券	1.6250	3,280	3,265		350,737	2022/08/31
US T N/B 2.75 08/15/21	国債証券	2.7500	25,090	25,606		2,750,634	2021/08/15
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	7,430	7,915		850,256	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	9,800	9,876		1,060,937	2021/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,720	2,758		296,357	2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	9,000	8,843		950,006	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	5,360	5,356		575,362	2022/09/30
US T N/B 2.0 09/30/20	国債証券	2.0000	12,660	12,677		1,361,841	2020/09/30
US T N/B 1.375 09/30/20	国債証券	1.3750	10,640	10,570		1,135,439	2020/09/30
US T N/B 1.125 09/30/21	国債証券	1.1250	430	423		45,544	2021/09/30
US T N/B 1.875 09/30/22	国債証券	1.8750	8,860	8,891		955,081	2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	7,810	8,152		875,712	2023/09/30
US T N/B 2.75 09/15/21	国債証券	2.7500	2,960	3,024		324,853	2021/09/15
US T N/B 2.75 09/30/20	国債証券	2.7500	18,860	19,059		2,047,375	2020/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	4,560	4,651		499,631	2024/10/31
US T N/B 1.875 10/31/22	国債証券	1.8750	12,380	12,420		1,334,221	2022/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	6,560	6,987		750,641	2025/10/31
US T N/B 1.25 10/31/21	国債証券	1.2500	10,500	10,373		1,114,329	2021/10/31
US T N/B 2.875 10/15/21	国債証券	2.8750	13,100	13,425		1,442,213	2021/10/15
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	1,780	1,766		189,773	2023/10/31

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額	金額	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 1.375 10/31/20	国債証券	1.3750	10,000	9,935	1,067,228	2020/10/31
US T N/B 2.0 10/31/22	国債証券	2.0000	4,280	4,311	463,132	2022/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	9,290	9,705	1,042,519	2023/10/31
US T N/B 2.875 10/31/20	国債証券	2.8750	16,820	17,045	1,830,997	2020/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	2,100	2,403	258,158	2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,700	2,163	232,376	2028/11/15
US T N/B 6.5 11/15/26	国債証券	6.5000	500	656	70,472	2026/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,050	2,700	290,075	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	9,340	10,091	1,084,028	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	3,650	4,749	510,166	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	10,550	10,942	1,175,416	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	2,350	2,604	279,828	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	7,740	9,431	1,013,173	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	6,690	6,899	741,147	2047/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	8,800	9,528	1,023,500	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	13,320	14,078	1,512,320	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	12,600	12,856	1,381,089	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	2,340	3,087	331,660	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	14,200	16,500	1,772,518	2048/11/15
US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	2.6250	11,860	11,983	1,287,238	2020/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	7,900	7,944	853,353	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	25,880	26,405	2,836,492	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	21,320	23,259	2,498,533	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	1,120	1,114	119,731	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	13,330	13,862	1,489,070	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	8,900	8,930	959,317	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	12,020	12,109	1,300,769	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	12,870	13,107	1,407,974	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	10,290	10,430	1,120,461	2023/11/30
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	3,970	4,026	432,487	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	6,780	7,174	770,695	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	9,810	10,259	1,102,032	2023/11/30
US T N/B 1.625 11/30/20	国債証券	1.6250	10,000	9,966	1,070,590	2020/11/30
US T N/B 1.75 11/30/21	国債証券	1.7500	1,380	1,379	148,169	2021/11/30
US T N/B 2.875 11/15/21	国債証券	2.8750	8,440	8,657	929,961	2021/11/15
US T N/B 2.75 11/30/20	国債証券	2.7500	5,110	5,174	555,838	2020/11/30
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	9,550	9,737	1,046,049	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	9,670	10,011	1,075,429	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	7,300	7,616	818,159	2025/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	7,000	7,061	758,572	2021/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	4,530	4,622	496,534	2024/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	13,500	13,659	1,467,267	2022/12/31
US T N/B 1.75 12/31/20	国債証券	1.7500	12,590	12,571	1,350,402	2020/12/31
US T N/B 2.0 12/31/21	国債証券	2.0000	14,720	14,807	1,590,599	2021/12/31
US T N/B 2.625 12/15/21	国債証券	2.6250	11,320	11,559	1,241,688	2021/12/15
US T N/B 2.5 12/31/20	国債証券	2.5000	14,350	14,488	1,556,336	2020/12/31
小計	-	-	1,897,040	1,959,720	210,513,189	-
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 02/01/21	国債証券	2.2500	1,680	1,700	138,421	2021/02/01
CANADA 0.75 03/01/21	国債証券	0.7500	5,890	5,820	473,691	2021/03/01
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	2,410	2,507	204,121	2024/03/01
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	3,550	3,466	282,135	2022/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	3,740	3,789	308,404	2023/03/01
CANADA 1.75 05/01/21	国債証券	1.7500	3,180	3,198	260,334	2021/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	3,020	3,035	247,071	2026/06/01

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	900	1,338	108,916		2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	3,000	4,167	339,181		2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	2,530	3,844	312,935		2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	2,900	4,389	357,249		2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	3,600	3,794	308,837		2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	3,260	4,610	375,255		2041/06/01
CANADA 3.25 06/01/21	国債証券	3.2500	2,400	2,483	202,114		2021/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	3,350	3,479	283,235		2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	3,690	3,706	301,707		2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	2,690	2,809	228,633		2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	3,110	3,261	265,460		2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	3,890	3,760	306,041		2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	2,590	2,772	225,650		2029/06/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	5,860	5,776	470,182		2021/09/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	1,230	1,238	100,769		2024/09/01
CANADA 0.75 09/01/20	国債証券	0.7500	9,530	9,434	767,905		2020/09/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	2,820	2,891	235,319		2023/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	3,030	2,992	243,588		2022/09/01
CANADA 2.0 11/01/20	国債証券	2.0000	2,740	2,756	224,360		2020/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	3,920	5,405	439,968		2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	3,670	4,540	369,523		2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	1,470	1,575	128,222		2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	1,010	1,351	110,001		2064/12/01
小計	—	—	96,660	105,900	8,619,241		—
(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	2,990	3,702	276,669		2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	5,940	6,683	499,396		2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	6,170	7,811	583,645		2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	6,850	7,431	555,276		2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	9,490	11,438	854,690		2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	5,470	6,413	479,218		2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	5,740	6,781	506,689		2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	2,870	3,979	297,332		2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	2,520	3,357	250,885		2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	5,770	6,235	465,883		2028/05/21
AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	国債証券	5.7500	6,540	7,131	532,873		2021/05/15
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	3,530	3,956	295,647		2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	1,050	1,228	91,773		2041/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	1,980	2,500	186,855		2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	1,770	2,078	155,303		2035/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	7,000	8,022	599,456		2022/07/15
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	5,400	6,103	456,058		2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	5,540	6,206	463,713		2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	8,170	9,321	696,500		2029/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	国債証券	1.7500	2,950	2,982	222,861		2020/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	3,080	3,219	240,562		2022/11/21
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券	2.0000	3,020	3,102	231,787		2021/12/21
小計	—	—	103,840	119,687	8,943,082		—
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	580	585	46,504		2024/02/01
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	1,700	1,702	135,100		2023/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	1,650	1,838	145,871		2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	1,580	1,646	130,655		2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	1,010	1,062	84,281		2042/04/01
SINGAPORE 1.75 04/01/22	国債証券	1.7500	30	30	2,387		2022/04/01

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	1,020	1,073	85,196		2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	920	949	75,347		2025/06/01
SINGAPORE 2.25 06/01/21	国債証券	2.2500	2,440	2,468	195,929		2021/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	810	824	65,406		2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	620	667	52,982		2029/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	1,280	1,330	105,552		2023/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	830	819	65,023		2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	1,110	1,175	93,304		2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	1,200	1,253	99,498		2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	900	968	76,852		2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	1,210	1,378	109,364		2033/09/01
小計	-	-	18,890	19,773	1,569,259		-
(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	5,380	7,384	1,011,245		2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	5,480	7,874	1,078,369		2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	3,560	6,480	887,505		2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	720	771	105,626		2049/01/22
UK TREASURY 1.5 01/22/21	国債証券	1.5000	4,900	4,968	680,420		2021/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	4,180	5,197	711,704		2025/03/07
UK TREASURY 4.0 03/07/22	国債証券	4.0000	2,350	2,566	351,476		2022/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	3,920	5,696	780,031		2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	5,680	5,779	791,431		2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	4,750	6,578	900,828		2032/06/07
UK TREASURY 8.0 06/07/21	国債証券	8.0000	1,520	1,739	238,197		2021/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	4,620	4,670	639,558		2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	3,670	5,941	813,660		2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	4,190	4,656	637,697		2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	3,840	5,351	732,766		2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	4,500	7,947	1,088,262		2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	3,950	4,169	570,987		2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	4,480	4,650	636,828		2027/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	5,710	5,697	780,269		2022/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	5,830	5,864	803,094		2023/07/22
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	3,560	5,384	737,402		2039/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/21	国債証券	3.7500	2,410	2,577	352,978		2021/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	3,820	4,082	558,996		2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	2,500	2,771	379,508		2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	1,650	1,785	244,546		2025/09/07
UK TREASURY 3.75 09/07/20	国債証券	3.7500	4,790	4,966	680,068		2020/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	3,820	5,583	764,631		2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	4,970	5,307	726,803		2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	5,920	6,140	840,947		2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	1,420	1,508	206,522		2054/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	2,010	2,233	305,807		2071/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	5,650	6,042	827,507		2028/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	1,450	2,133	292,171		2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	3,470	5,517	755,539		2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	4,040	6,532	894,529		2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	3,750	6,123	838,483		2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	3,690	6,709	918,853		2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	3,290	4,235	580,051		2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	4,770	7,309	1,000,969		2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	2,980	4,209	576,496		2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	4,440	7,518	1,029,610		2049/12/07
小計	-	-	157,630	202,660	27,752,388		-

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	外貨換算金額		
(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	26,240	49,906	816,976	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	12,910	14,841	242,959	2025/11/15	
DENMARK 3.0 11/15/21	国債証券	3.0000	18,170	19,796	324,064	2021/11/15	
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	8,570	9,399	153,871	2023/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	17,060	18,379	300,865	2027/11/15	
小計	—	—	82,950	112,323	1,838,735	—	
(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	8,260	8,369	105,870	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	7,030	7,237	91,552	2027/02/17	
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	9,430	10,196	128,981	2024/03/14	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	5,990	6,164	77,979	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	7,420	7,779	98,405	2028/04/26	
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	15,430	15,894	201,060	2023/05/24	
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	4,710	4,842	61,260	2029/09/06	
小計	—	—	58,270	60,483	765,110	—	
(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	9,750	15,234	175,196	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	9,300	10,015	115,174	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	13,830	16,222	186,562	2025/05/12	
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	21,630	24,290	279,345	2022/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	18,180	19,837	228,128	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	12,360	13,492	155,165	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	8,570	9,229	106,136	2029/11/12	
小計	—	—	93,620	108,322	1,245,710	—	
(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	38,064	34,490	194,183	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	37,071	39,323	221,388	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	34,054	34,300	193,114	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	61,151	60,822	342,431	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	54,715	53,221	299,635	2022/06/09	
MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	国債証券	6.5000	56,340	55,189	310,717	2021/06/10	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	6,000	6,112	34,414	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	44,721	44,268	249,233	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	20,296	20,585	115,897	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	37,143	39,737	223,723	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	17,086	20,749	116,817	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	19,500	19,560	110,127	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	66,505	73,941	416,291	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	49,237	50,126	282,210	2023/12/07	
MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	国債証券	7.2500	41,968	41,633	234,396	2021/12/09	
小計	—	—	583,851	594,064	3,344,583	—	
(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 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	3,910	3,922	101,665	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,480	1,552	40,241	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	2,820	2,997	77,689	2030/04/15	
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,180	1,206	31,266	2032/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,340	1,320	34,237	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	5,540	6,013	155,878	2037/04/07	
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	4,580	4,536	117,589	2027/05/31	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	2,000	2,080	53,932	2031/06/30	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,190	2,262	58,635	2024/07/15	
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	5,000	5,002	129,663	2022/08/15	
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,480	1,656	42,940	2028/09/15	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	4,400	4,503	116,729	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	3,470	3,775	97,857	2043/09/30	

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	外貨換算金額		
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円		
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,500	1,528	39,608	2026/11/30	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	1,050	1,124	29,141	2033/11/07	
小計	—	—	41,940	43,482	1,127,076	—	
(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	32,290	30,389	227,920	2030/01/31	
SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	国債証券	8.7500	33,480	29,951	224,634	2044/01/31	
SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	国債証券	9.0000	10,100	9,358	70,186	2040/01/31	
SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	国債証券	8.5000	36,310	32,804	246,037	2037/01/31	
SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	国債証券	8.7500	58,790	52,562	394,217	2048/02/28	
SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	国債証券	6.5000	13,680	9,589	71,919	2041/02/28	
SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	国債証券	7.7500	2,740	2,780	20,855	2023/02/28	
SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	国債証券	7.0000	17,190	14,635	109,766	2031/02/28	
SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	国債証券	8.8750	13,250	12,515	93,866	2035/02/28	
SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	国債証券	8.2500	13,000	12,066	90,497	2032/03/31	
SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	国債証券	6.2500	17,630	12,838	96,287	2036/03/31	
SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	国債証券	10.5000	43,910	49,712	372,842	2026/12/21	
小計	—	—	292,370	269,204	2,019,032	—	
(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	6,870	7,039	202,320	2023/01/25	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,800	2,337	67,179	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	8,680	8,925	256,510	2028/04/25	
POLAND 2.0 04/25/21	国債証券	2.0000	9,120	9,205	264,572	2021/04/25	
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	4,880	4,961	142,594	2022/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	6,690	6,854	197,008	2024/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	7,390	7,512	215,895	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	4,790	5,096	146,482	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	8,370	8,484	243,837	2027/07/25	
POLAND 1.75 07/25/21	国債証券	1.7500	4,510	4,530	130,213	2021/07/25	
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	4,570	5,143	147,827	2022/09/23	
POLAND 5.25 10/25/20	国債証券	5.2500	10,020	10,528	302,575	2020/10/25	
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.7500	2,690	2,947	84,719	2021/10/25	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	10,380	11,280	324,209	2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	1,230	1,271	36,547	2029/10/25	
小計	—	—	91,990	96,120	2,762,493	—	
(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	1,710	2,097	256,417	2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	400	441	54,013	2031/03/18	
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	1,870	2,204	269,529	2024/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	3,740	4,944	604,356	2025/03/13	
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	4,040	4,701	574,747	2023/03/20	
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0.8000	2,320	2,402	293,724	2022/03/15	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	640	692	84,665	2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	810	884	108,076	2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	2,250	2,743	335,405	2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	1,540	1,647	201,389	2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	770	834	101,952	2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	2,800	3,013	368,383	2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	1,020	1,169	143,013	2037/05/15	
IRISH 5.0 10/18/20	国債証券	5.0000	3,460	3,714	454,113	2020/10/18	
IRISH 10/18/22	国債証券	—	2,800	2,842	347,406	2022/10/18	
小計	—	—	30,170	34,335	4,197,194	—	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.5000	590	764	93,404	2023/01/15	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	3,760	6,656	813,678	2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	2,940	4,815	588,680	2047/01/15	

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	千円	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	1,670	1,938	236,966	2023/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	2,070	3,110	380,187	2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	3,260	5,435	664,462	2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	3,370	4,494	549,362	2033/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,050	1,095	133,895	2040/01/15	
NETHERLANDS 01/15/22	国債証券	—	4,490	4,569	558,627	2022/01/15	
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	—	3,980	4,082	499,077	2024/01/15	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	国債証券	3.5000	3,940	4,113	502,855	2020/07/15	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	国債証券	3.2500	5,240	5,671	693,247	2021/07/15	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	5,200	5,705	697,388	2023/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	3,140	3,340	408,283	2026/07/15	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	7,500	8,185	1,000,540	2022/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	3,590	4,056	495,917	2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	4,130	4,308	526,706	2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	2,340	2,545	311,121	2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	3,670	3,978	486,372	2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	2,260	2,343	286,478	2029/07/15	
小計	—	—	68,190	81,211	9,927,255	—	
(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	2,130	2,406	294,196	2022/03/28	
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	3,370	5,002	611,492	2028/03/28	
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	4,350	7,350	898,567	2041/03/28	
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	2,220	2,934	358,722	2026/03/28	
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	1,550	2,269	277,387	2032/03/28	
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	6,370	10,694	1,307,236	2035/03/28	
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	700	779	95,327	2033/04/22	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	3,060	5,084	621,528	2045/06/22	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	2,230	2,565	313,661	2047/06/22	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	1,180	1,372	167,754	2050/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	810	1,057	129,284	2057/06/22	
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	900	1,172	143,317	2066/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	3,770	4,088	499,726	2026/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	4,580	5,277	645,103	2024/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	3,220	3,493	427,065	2031/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	2,950	3,285	401,619	2023/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	3,390	3,629	443,624	2028/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,330	1,432	175,159	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	1,410	1,927	235,677	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	1,220	1,478	180,707	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	2,430	2,590	316,618	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	2,050	2,195	268,416	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	1,000	1,129	138,111	2037/06/22	
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.2500	7,470	8,307	1,015,568	2021/09/28	
BELGIUM 3.75 09/28/20	国債証券	3.7500	5,060	5,338	652,572	2020/09/28	
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	4,100	4,759	581,779	2022/09/28	
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	1,500	1,569	191,834	2024/10/22	
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	2,020	2,082	254,579	2023/10/22	
小計	—	—	76,370	95,276	11,646,643	—	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 02/25/22	国債証券	—	2,810	2,856	349,155	2022/02/25	
FRANCE OAT 02/25/21	国債証券	—	7,080	7,157	874,901	2021/02/25	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	—	4,560	4,663	570,006	2024/03/25	
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	—	5,720	5,848	714,868	2023/03/25	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	国債証券	3.7500	5,510	5,959	728,543	2021/04/25	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,480	2,003	244,877	2023/04/25	

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	
				千ユーロ	千円		
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	7,840	9,922	1,212,902	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	7,740	13,766	1,682,838	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	3,340	6,280	767,732	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	2,440	4,769	583,031	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	10,630	16,395	2,004,185	2029/04/25	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	7,350	8,119	992,551	2022/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	5,390	8,991	1,099,073	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	5,600	8,767	1,071,681	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	5,150	6,540	799,554	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	2,060	2,337	285,721	2050/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	3,280	3,955	483,574	2066/05/25	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	8,220	9,335	1,141,165	2024/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	8,110	10,204	1,247,386	2030/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,470	5,865	716,976	2028/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	15,580	17,950	2,194,287	2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	7,840	8,246	1,008,100	2025/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	4,530	4,730	578,305	2029/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	4,080	4,574	559,216	2034/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	10,560	11,123	1,359,773	2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	5,000	5,462	667,736	2027/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	7,450	8,140	995,063	2023/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	5,350	5,980	731,088	2036/05/25	
FRANCE OAT 05/25/22	国債証券	-	5,500	5,604	685,060	2022/05/25	
FRANCE OAT 05/25/21	国債証券	-	4,160	4,212	514,895	2021/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	4,200	5,067	619,447	2039/06/25	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	10,990	13,314	1,627,617	2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,220	3,121	381,517	2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	10,570	13,153	1,607,873	2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	7,710	12,554	1,534,709	2038/10/25	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3.2500	6,000	6,554	801,246	2021/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	9,960	17,160	2,097,758	2032/10/25	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	13,640	14,963	1,829,103	2022/10/25	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	国債証券	2.5000	4,310	4,490	548,977	2020/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	9,220	10,321	1,261,701	2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	15,190	16,490	2,015,788	2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	6,490	6,713	820,676	2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	6,690	7,163	875,627	2028/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	国債証券	0.2500	4,300	4,353	532,218	2020/11/25	
小計	-	-	291,320	355,190	43,418,518	-	
(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	1,180	1,556	190,279	2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	3,440	5,245	641,149	2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	1,400	2,382	291,270	2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	7,900	13,206	1,614,421	2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	4,010	6,811	832,677	2037/01/04	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2.0000	8,030	8,594	1,050,543	2022/01/04	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	国債証券	2.5000	2,200	2,311	282,530	2021/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	3,440	3,656	446,913	2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	6,250	6,686	817,357	2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	4,420	4,650	568,526	2029/02/15	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	3,100	3,354	410,009	2023/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	3,330	3,588	438,606	2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	4,200	4,678	571,854	2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	7,580	7,996	977,541	2027/02/15	
BUNDESSCHAT 03/12/21	国債証券	-	1,640	1,660	203,003	2021/03/12	

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		
BUNDESUBL 04/09/21	国債証券	—	2,850	2,887	352,951	2021/04/09	
BUNDESUBL 04/08/22	国債証券	—	2,500	2,551	311,941	2022/04/08	
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	—	2,960	3,040	371,708	2023/04/14	
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	—	5,990	6,174	754,718	2024/04/05	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	7,210	7,979	975,355	2024/05/15	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	3,070	3,337	408,034	2023/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,670	2,616	319,884	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,800	2,647	323,607	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	3,740	6,825	834,321	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	5,700	9,674	1,182,561	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	5,950	9,239	1,129,489	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	2,980	5,859	716,267	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.2500	2,490	2,693	329,205	2021/07/04	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	国債証券	3.0000	3,200	3,321	405,981	2020/07/04	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	9,530	10,257	1,253,890	2022/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	4,120	7,131	871,700	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	5,250	8,330	1,018,312	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	4,460	5,649	690,619	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	3,410	3,744	457,684	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	4,490	4,833	590,900	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	—	7,360	7,626	932,291	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	3,420	3,604	440,602	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	2,900	3,229	394,713	2023/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	3,100	3,364	411,248	2024/08/15	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	2,700	2,879	351,976	2021/09/04	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	国債証券	2.2500	3,000	3,106	379,767	2020/09/04	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	3,300	3,539	432,650	2022/09/04	
BUNDESSCHAT 09/11/20	国債証券	—	5,060	5,102	623,785	2020/09/11	
BUNDESUBL 10/08/21	国債証券	—	3,400	3,458	422,814	2021/10/08	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	国債証券	0.2500	3,000	3,037	371,340	2020/10/16	
BUNDESUBL 10/07/22	国債証券	—	3,000	3,072	375,561	2022/10/07	
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	—	4,800	4,941	604,061	2023/10/13	
小計	—	—	190,530	232,138	28,376,636	—	
(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	4,160	4,833	590,806	2022/01/31	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	3,500	5,357	654,958	2029/01/31	
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	3,000	3,688	450,911	2024/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	5,190	7,908	966,756	2037/01/31	
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	6,210	7,481	914,485	2023/01/31	
SPAIN 0.05 01/31/21	国債証券	0.0500	2,500	2,517	307,748	2021/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	3,100	3,393	414,822	2025/04/30	
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	5,600	6,672	815,586	2024/04/30	
SPAIN 5.5 04/30/21	国債証券	5.5000	3,710	4,114	502,974	2021/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,700	2,965	362,491	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	3,000	3,375	412,655	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	3,760	4,114	503,001	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	5,320	5,836	713,488	2029/04/30	
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	3,300	3,368	411,818	2022/04/30	
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	4,440	6,246	763,605	2026/07/30	
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	4,360	7,454	911,265	2040/07/30	
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	3,390	5,724	699,753	2041/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	2,350	3,621	442,748	2066/07/30	
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	4,820	6,186	756,210	2025/07/30	
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	4,840	5,568	680,701	2030/07/30	
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	4,390	7,209	881,307	2032/07/30	

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	千円	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	3,210	3,873	473,458	2033/07/30	
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	3,770	4,119	503,532	2028/07/30	
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	2,770	3,141	384,048	2035/07/30	
SPAIN 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	2,680	2,744	335,491	2021/07/30	
SPAIN 1.15 07/30/20	国債証券	1.1500	4,500	4,578	559,733	2020/07/30	
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	3,270	3,345	408,906	2023/07/30	
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	12,920	14,877	1,818,674	2024/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	4,410	6,366	778,267	2028/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	2,510	4,604	562,899	2044/10/31	
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	4,820	6,494	793,925	2046/10/31	
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,730	2,253	275,516	2048/10/31	
SPAIN 4.85 10/31/20	国債証券	4.8500	2,630	2,818	344,477	2020/10/31	
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	4,650	5,269	644,151	2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	12,730	13,964	1,706,996	2027/10/31	
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	12,120	13,122	1,604,072	2026/10/31	
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	4,080	4,897	598,676	2023/10/31	
SPAIN 0.05 10/31/21	国債証券	0.0500	6,080	6,138	750,339	2021/10/31	
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	2,600	2,664	325,702	2022/10/31	
小計	-	-	175,120	212,916	26,026,971	-	
(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	3,440	4,732	578,489	2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	11,650	13,767	1,682,996	2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	7,300	7,383	902,551	2028/02/01	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	2,650	2,553	312,177	2047/03/01	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	8,640	9,403	1,149,517	2048/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	3,500	4,003	489,337	2024/03/01	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	1,100	1,015	124,123	2067/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	3,860	4,588	560,897	2025/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	2,500	2,783	340,193	2022/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	10,660	12,558	1,535,156	2026/03/01	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	国債証券	3.7500	2,950	3,125	382,060	2021/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	3,300	3,076	376,090	2032/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	3,370	3,687	450,704	2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	3,980	4,457	544,911	2030/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	2,700	2,690	328,925	2023/03/15	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	2,000	1,994	243,761	2023/03/01	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	3,000	3,047	372,532	2022/04/15	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	2,700	2,733	334,107	2022/04/01	
ITALY BTPS 0.05 04/15/21	国債証券	0.0500	950	946	115,698	2021/04/15	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	4,300	5,930	724,951	2031/05/01	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	2,600	2,932	358,422	2023/05/01	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	国債証券	3.7500	3,000	3,189	389,907	2021/05/01	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	2,800	2,871	350,965	2024/05/15	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	5,980	5,964	729,131	2025/05/15	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	3,300	3,295	402,786	2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	7,430	7,420	907,080	2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	2,500	2,573	314,523	2027/06/01	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	国債証券	0.4500	3,750	3,757	459,321	2021/06/01	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	6,930	7,407	905,489	2021/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	5,450	7,100	867,935	2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	4,160	5,500	672,363	2039/08/01	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	4,010	4,585	560,572	2023/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	5,700	5,796	708,529	2027/08/01	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	3,850	4,146	506,843	2029/08/01	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	3,000	3,003	367,182	2022/08/01	

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	千円	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	2,130	2,187	267,414	2038/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	6,970	9,048	1,106,091	2044/09/01	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	2,900	3,075	375,996	2046/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	8,450	10,468	1,279,684	2028/09/01	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	4,630	6,090	744,535	2040/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.7500	3,810	4,159	508,488	2021/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	2,650	2,657	324,898	2033/09/01	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	国債証券	4.0000	4,220	4,421	540,428	2020/09/01	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	6,380	7,116	869,921	2024/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	3,970	4,540	555,000	2049/09/01	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	2,960	3,385	413,796	2022/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	2,400	2,305	281,816	2036/09/01	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	4,140	4,213	515,041	2022/09/15	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	1,870	1,834	224,188	2023/10/15	
ITALY BTPS 2.3 10/15/21	国債証券	2.3000	3,300	3,432	419,584	2021/10/15	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	3,030	3,185	389,425	2023/10/01	
ITALY BTPS 0.2 10/15/20	国債証券	0.2000	2,500	2,505	306,318	2020/10/15	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,700	2,259	276,197	2023/11/01	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	2,150	2,960	361,923	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	3,400	4,602	562,619	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	6,380	8,181	1,000,054	2029/11/01	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	3,200	3,676	449,358	2022/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	2,800	2,802	342,600	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	3,430	3,611	441,484	2025/11/15	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	国債証券	0.6500	2,000	2,015	246,391	2020/11/01	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	国債証券	0.3500	10,200	10,167	1,242,845	2021/11/01	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	2,900	2,971	363,269	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	3,500	3,402	415,946	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	2,650	2,794	341,609	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	3,190	3,404	416,107	2028/12/01	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国債証券	2.1500	2,000	2,074	253,599	2021/12/15	
小計	—	—	264,820	293,577	35,886,879	—	
(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	1,610	1,806	220,769	2024/04/15	
FINLAND 3.5 04/15/21	国債証券	3.5000	2,460	2,645	323,408	2021/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	750	805	98,520	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	470	568	69,474	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	910	959	117,310	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	750	843	103,086	2034/04/15	
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	3,510	3,789	463,172	2023/04/15	
FINLAND 04/15/22	国債証券	—	2,230	2,269	277,398	2022/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	1,330	1,688	206,392	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	700	881	107,807	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	780	1,153	141,031	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	640	671	82,115	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	780	840	102,725	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	650	684	83,705	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	600	632	77,319	2027/09/15	
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	3,580	3,839	469,390	2022/09/15	
FINLAND 09/15/23	国債証券	—	2,090	2,137	261,293	2023/09/15	
FINLAND 0.375 09/15/20	国債証券	0.3750	5,640	5,710	698,072	2020/09/15	
小計	—	—	29,480	31,928	3,902,995	—	
(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	1,150	2,365	289,145	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	1,250	1,499	183,239	2047/02/20	

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		
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	2,960	3,103	379,375	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	2,030	2,181	266,721	2028/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	1,620	2,191	267,921	2026/03/15	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	2,840	4,639	567,157	2037/03/15	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	国債証券	3.6500	3,420	3,836	468,980	2022/04/20	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	2,300	2,426	296,606	2027/04/20	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	1,360	1,768	216,188	2034/05/23	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	1,760	2,797	341,938	2044/06/20	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	国債証券	3.9000	2,450	2,565	313,563	2020/07/15	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	1,160	1,768	216,187	2027/07/15	
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	—	1,430	1,461	178,631	2023/07/15	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	3,850	4,208	514,392	2021/09/15	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	910	1,412	172,623	2117/09/20	
AUSTRIA 09/20/22	国債証券	—	3,400	3,467	423,886	2022/09/20	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	4,150	4,616	564,366	2024/10/21	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	2,040	2,189	267,698	2026/10/20	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	1,940	2,133	260,834	2025/10/20	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	2,750	3,026	370,011	2023/10/20	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	410	495	60,603	2086/11/02	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	3,350	3,811	465,872	2022/11/22	
小 計	—	—	48,530	57,967	7,085,945	—	
合 計	—	—	—	—	440,968,947	—	

■投資信託財産の構成

2019年6月24日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
公 社 債	千円	%	
コーポレートローン等、その他	440,968,947	96.5	
投資信託財産総額	15,870,707	3.5	
	456,839,654	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、451,345,121千円、98.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2019年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.42円、1カナダ・ドル=81.39円、1オーストラリア・ドル=74.72円、1シンガポール・ドル=79.36円、1イギリス・ポンド=136.94円、1デンマーク・クローネ=16.37円、1ノルウェー・クローネ=12.65円、1スウェーデン・クローナ=11.50円、1メキシコ・ペソ=5.63円、1マレーシア・リンギット=25.92円、1南アフリカ・ランド=7.50円、1ポーランド・ズロチ=28.74円、1ユーロ=122.24円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年6月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	901,512,323,487円
コ ー ル ・ 公 社 債(評価額)	10,602,452,655
未 収 入 金	440,968,947,653
未 収 利 息	446,677,308,686
前 払 費 用	2,291,367,499
(B) 負 債	446,653,996,538
未 払 金	446,512,220,538
未 払 解 約 金	141,776,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	454,858,326,949
元 本	327,518,238,620
次 期 繰 越 損 益 金	127,340,088,329
(D) 受 益 権 総 口 数	327,518,238,620口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	13,888円

(注1) 期首元本額 219,492,082,847円
 追加設定元本額 318,381,509,298円
 一部解約元本額 210,355,353,525円

(注2) 期末における元本の内訳

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	3,224,600,502円
たわらノーロード バランス (堅実型)	65,645,542円
たわらノーロード バランス (標準型)	185,013,476円
たわらノーロード バランス (積極型)	97,413,863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)	5,188,706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)	154,058,984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)	224,161,212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)	77,130,935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)	53,023,594円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	2,888,993円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,911,149円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	5,903,650円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,921,029円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	1,630,421円
投資のソムリエ	43,865,840,177円
投資のソムリエ<DC年金>	4,581,689,980円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	3,438,212,320円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	48,208,802,056円
ワールドアセットバランス (基本コース)	4,185,978,240円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	16,092,225,458円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	15,393,523円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	13,286,347円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	25,234,208円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	31,891,818円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,076,059,496円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	402,018,567円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	2,786,156円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	2,786,156円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	2,786,156円
外国債券パッシブファンド2 (為替フルヘッジ) (適格機関投資家限定)	20,018,593,420円
先進国債券パッシブファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	104,519,210,396円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	6,414,554,911円

DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	117,947,641円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	3,904,515,819円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	23,815,754,097円
DIAMバランス30VA (適格機関投資家限定)	26,541,840円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	27,336,766,237円
DIAMバランス20VA (適格機関投資家限定)	141,340,484円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA (1212) (適格機関投資家限定)	2,314,215,501円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA (1303) (適格機関投資家限定)	2,463,946,681円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA (1306) (適格機関投資家限定)	3,267,487,092円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA (1309) (適格機関投資家限定)	129,881,787円
期末元本合計	327,518,238,620円

■損益の状況

当期 自2018年6月23日 至2019年6月24日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		7,319,339,939円
受 取 利 息		7,324,148,475
支 払 利 息		△4,808,536
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		10,366,235,165
売 買 益		58,948,076,732
売 買 損		△48,581,841,567
(C) そ の 他 費 用		△34,367,885
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		17,651,207,219
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		71,240,884,883
(F) 解 約 差 損 益 金		△69,764,609,475
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		108,212,605,702
(H) 合 計(D + E + F + G)		127,340,088,329
次 期 繰 越 損 益 金(H)		127,340,088,329

(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) (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。