

運用報告書 (全体版)

第4期<決算日2020年10月12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、2020年10月12日に第4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 騰 落 率	期 騰 落 率	中 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
4期 (2020年10月12日)	10,596	0	3.9	428.67	4.4	99.1	-	8,419

(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) 2019 年 10 月 15 日	10,203	% -	410.49	% -	98.7	% -
10 月 末	10,149	△0.5	408.17	△0.6	99.3	-
11 月 末	10,142	△0.6	407.93	△0.6	96.1	-
12 月 末	10,077	△1.2	405.42	△1.2	98.8	-
2020 年 1 月 末	10,258	0.5	412.91	0.6	96.8	-
2 月 末	10,373	1.7	417.52	1.7	107.6	-
3 月 末	10,514	3.0	423.40	3.1	97.3	-
4 月 末	10,497	2.9	423.84	3.3	95.0	-
5 月 末	10,485	2.8	423.57	3.2	98.0	-
6 月 末	10,559	3.5	426.81	4.0	99.1	-
7 月 末	10,661	4.5	431.07	5.0	99.4	-
8 月 末	10,527	3.2	425.73	3.7	94.1	-
9 月 末	10,638	4.3	430.39	4.8	97.8	-
(期 末) 2020 年 10 月 12 日	10,596	3.9	428.67	4.4	99.1	-

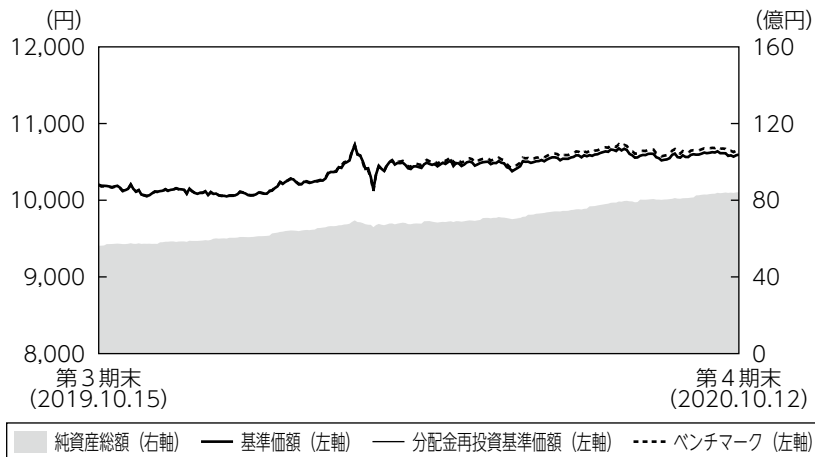
(注1) 騰落率は期首比です。

(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4期首：10,203円
第4期末：10,596円
(既払分配金0円)
騰落率：3.9%
(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。

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。

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。

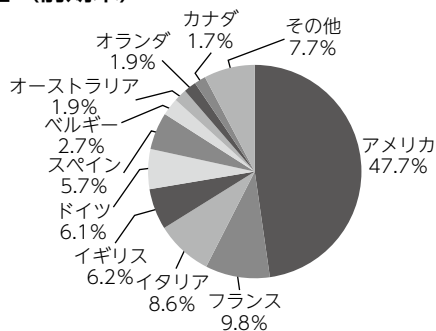
●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

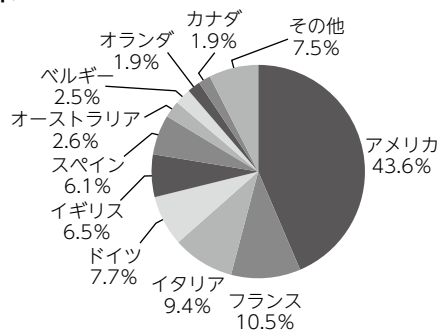
【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○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。

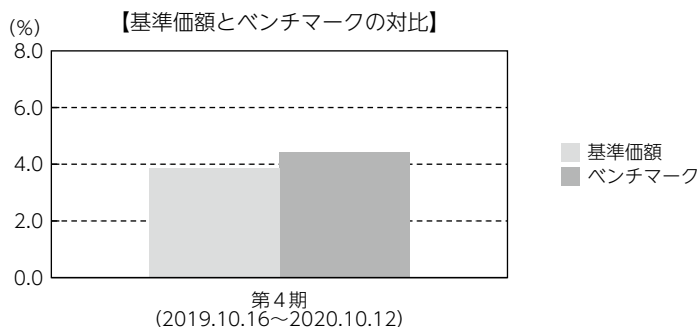
(注3) 上位11位以下をその他に含めて集計しています。

(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4.4%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.6%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
	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	899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4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	23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10,387円です。
(投信会社)	(10)	(0.095)	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)	(10)	(0.095)	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)	(3)	(0.027)	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	0.015	(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)	(0.011)	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	24	0.233	

(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。

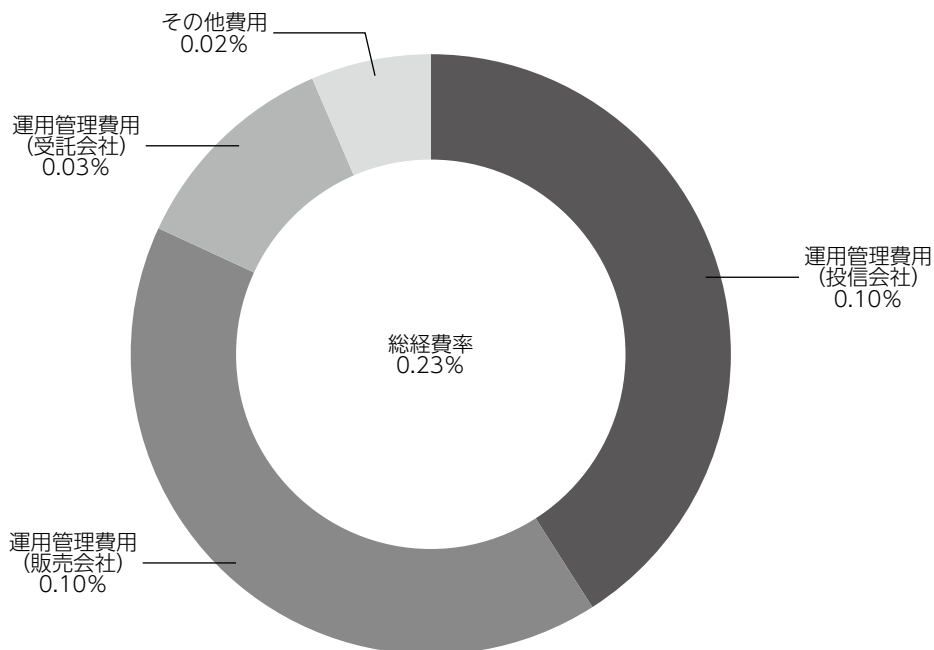
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（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
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	千□ 2,027,461	千円 2,940,053	千□ 293,833	千円 425,163

■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
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	千□ 3,959,786	千□ 5,693,414	千円 8,418,851

■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
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	8,418,851	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	21,550	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	8,440,402	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、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458,590,267千円、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、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	8,440,402,850円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	21,550,936
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)	8,418,851,914
(B) 負 債	20,945,630
未 払 解 約 金	12,613,697
未 払 信 託 報 酬	8,195,314
そ の 他 未 払 費 用	136,619
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,419,457,220
元 本	7,946,124,217
次 期 繰 越 損 益 金	473,333,003
(D) 受 益 権 総 口 数	7,946,124,217口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	10,596円

(注) 期首における元本額は5,514,416,355円、当期中における追加設定元本額は4,840,578,985円、同解約元本額は2,408,871,123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	△9,211円
受 取 利 息	1,542
支 払 利 息	△10,753
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	241,572,266
売 買 益	283,964,630
売 買 損	△42,392,364
(C) 信 託 報 酬 等	△15,291,059
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	226,271,996
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	160,025,786
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	87,035,221
(配 当 等 相 当 額)	(323,648,162)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△236,612,941)
(G) 合 計(D+E+F)	473,333,003
次 期 繰 越 損 益 金(G)	473,333,003
追 加 信 託 差 損 益 金	87,035,221
(配 当 等 相 当 額)	(328,183,547)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△241,148,326)
分 配 準 備 積 立 金	386,297,782

(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	132,023,465円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	94,248,531
(c) 収 益 調 整 金	328,183,547
(d) 分 配 準 備 積 立 金	160,025,786
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	714,481,329
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	899.16
(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13期 (決算日 2020年6月22日)

(計算期間 2019年6月25日～2020年6月22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13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	%	(除く日本、円ベース、為替ヘッジあり)(ベンチマーク)	期中騰落率			
9期(2016年6月22日)	13,626	5.4	ポイント 391.61	% 5.5	% 92.9	% -	百万円 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
13期(2020年6月22日)	14,658	5.5	424.77	6.0	100.6	-	337,333

(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)。

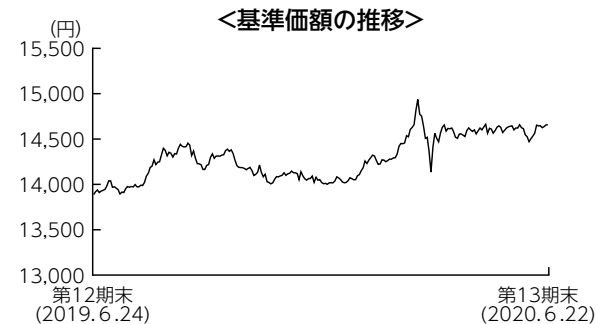
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2019 年 6 月 24 日	円 13,888	% -	ポイント 400.89	% -	% 96.9	% -
6 月 末	13,926	0.3	401.98	0.3	97.6	-
7 月 末	13,987	0.7	403.79	0.7	96.8	-
8 月 末	14,420	3.8	416.34	3.9	95.2	-
9 月 末	14,313	3.1	413.28	3.1	97.4	-
10 月 末	14,134	1.8	408.17	1.8	99.3	-
11 月 末	14,127	1.7	407.93	1.8	96.1	-
12 月 末	14,039	1.1	405.42	1.1	98.8	-
2020 年 1 月 末	14,294	2.9	412.91	3.0	96.8	-
2 月 末	14,456	4.1	417.52	4.1	107.6	-
3 月 末	14,655	5.5	423.40	5.6	97.3	-
4 月 末	14,634	5.4	423.84	5.7	95.0	-
5 月 末	14,621	5.3	423.57	5.7	98.0	-
(期 末) 2020 年 6 月 22 日	14,658	5.5	424.77	6.0	100.6	-

(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6月25日から2020年6月22日まで）

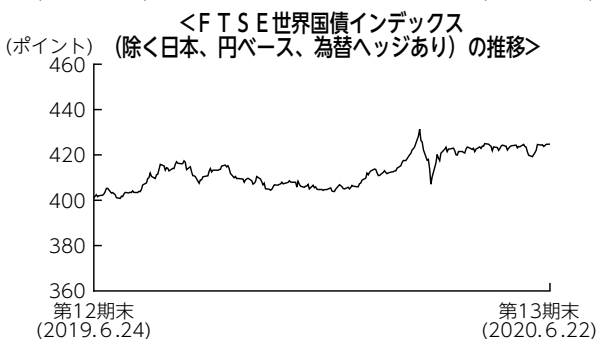


基準価額の推移

当期末の基準価額は14,658円となり、前期末比で5.5%上昇しました。

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）による緊急利下げや、原油価格の大幅下落等のリスク回避姿勢が高まり、米国債やドイツ国債の利回りが低下（価格は上昇）したことが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やリスク回避姿勢の高まりから債券が買われる展開となりました。

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6.0%上昇しました。当ファンドはベンチマークを0.4%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	0.010%
(その他)	(0)	(0.000)
合 計	1	0.010

(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(14,296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6月25日から2020年6月22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 1,961,406	千アメリカ・ドル 2,651,381 (-)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 103,417	千カナダ・ドル 129,463 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 156,999	千オーストラリア・ドル 176,305 (-)
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 17,234	千シンガポール・ドル 18,993 (-)
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 196,982	千イギリス・ポンド 249,658 (-)
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シケル 32,434	千イスラエル・シケル -
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 157,233	千デンマーク・クローネ 156,019 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 60,553	千ノルウェー・クローネ 61,084 (-)
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 61,184	千スウェーデン・クローナ 94,435 (-)
	国	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 557,818
マレーシア		国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 16,678	千マレーシア・リンギット -

			買付額	売付額
外	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 298,935	千南アフリカ・ランド 508,754 (-)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 70,663	千ポーランド・ズロチ 93,130 (-)
国	ユ ー ロ 区	アイルランド	千ユーロ 55,148	千ユーロ 67,143 (-)
		オランダ	53,327	77,853 (-)
		ベルギー	99,674	121,080 (-)
		フランス	362,239	426,114 (-)
		ドイツ	219,448	236,364 (-)
		スペイン	181,640	218,437 (-)
		イタリア	312,325	352,628 (-)
		フィンランド	44,313	58,887 (-)
		オーストリア	72,996	86,368 (-)

(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 (2019年6月25日から2020年6月22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 1,299,750	千アメリカ・ドル 1,450,949	千円 154,917,910	% 45.9	% -	% 20.4	% 17.6	% 7.9	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 73,980	千カナダ・ドル 84,974	千円 6,659,420	2.0	-	0.9	0.7	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 87,340	千オーストラリア・ドル 101,044	千円 7,362,104	2.2	-	1.5	0.7	-	
シンガポール	千シンガポール・ドル 17,430	千シンガポール・ドル 19,719	千円 1,506,137	0.4	-	0.2	0.2	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 121,440	千イギリス・ポンド 168,926	千円 22,261,093	6.6	-	5.2	1.4	-	
イスラエル	千イスラエル・シケル 26,270	千イスラエル・シケル 32,633	千円 1,008,704	0.3	-	0.2	0.1	-	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 86,680	千デンマーク・クローネ 109,914	千円 1,759,723	0.5	-	0.4	0.1	-	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 58,420	千ノルウェー・クローネ 63,153	千円 697,851	0.2	-	0.1	0.1	-	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 63,830	千スウェーデン・クローナ 72,925	千円 822,600	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 499,011	千メキシコ・ペソ 554,711	千円 2,618,237	0.8	-	0.4	0.3	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リングギット 57,530	千マレーシア・リングギット 62,250	千円 1,553,765	0.5	-	0.3	0.1	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 70,050	千ポーランド・ズロチ 76,665	千円 2,048,493	0.6	-	0.3	0.3	0.0	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	19,230	21,816	2,604,264	0.8	-	0.6	0.2	0.0	
オランダ	46,640	55,891	6,671,821	2.0	-	1.3	0.5	0.2	
ベルギー	58,880	72,640	8,671,119	2.6	-	2.0	0.3	0.3	
フランス	237,240	287,269	34,291,413	10.2	-	6.9	2.3	0.9	
ドイツ	178,790	214,538	25,609,478	7.6	-	4.5	2.4	0.7	
スペイン	138,830	168,809	20,150,842	6.0	-	4.2	1.3	0.5	
イタリア	227,440	259,095	30,928,195	9.2	-	5.4	3.0	0.8	
フィンランド	14,750	16,900	2,017,364	0.6	-	0.4	0.1	0.0	
オーストリア	36,220	44,139	5,268,925	1.6	-	1.0	0.4	0.2	
合 計	-	-	千円 339,429,470	100.6	-	56.3	32.3	12.1	

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当			期			末		
	種	類	利	評				額	
				外	額	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 2.625 01/31/26	国	債	証	券	2.6250	8,050	9,043	965,592	2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国	債	証	券	2.5000	5,160	5,676	606,069	2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国	債	証	券	2.2500	3,780	4,050	432,472	2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国	債	証	券	1.7500	8,180	8,508	908,450	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国	債	証	券	2.5000	10,750	11,616	1,240,317	2024/01/31
US T N/B 1.875 01/31/22	国	債	証	券	1.8750	6,840	7,024	749,990	2022/01/31
US T N/B 2.5 01/15/22	国	債	証	券	2.5000	14,320	14,832	1,583,713	2022/01/15
US T N/B 2.375 01/31/23	国	債	証	券	2.3750	2,760	2,915	311,307	2023/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国	債	証	券	1.5000	8,790	9,362	999,657	2027/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国	債	証	券	1.3750	960	1,006	107,472	2025/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国	債	証	券	6.0000	800	1,049	112,081	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国	債	証	券	3.1250	2,960	3,978	424,776	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国	債	証	券	3.1250	4,760	6,389	682,252	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国	債	証	券	2.5000	4,320	5,293	565,134	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国	債	証	券	3.5000	3,170	4,455	475,696	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国	債	証	券	5.2500	830	1,155	123,402	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国	債	証	券	5.3750	2,300	3,409	364,020	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国	債	証	券	4.5000	2,320	3,530	376,997	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国	債	証	券	4.7500	1,470	2,419	258,283	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国	債	証	券	3.6250	6,540	9,489	1,013,209	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国	債	証	券	3.0000	7,830	10,686	1,141,021	2049/02/15
US T N/B 2.0 02/15/22	国	債	証	券	2.0000	10,000	10,296	1,099,355	2022/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国	債	証	券	4.3750	1,210	1,868	199,490	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国	債	証	券	4.6250	2,790	4,493	479,763	2040/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国	債	証	券	1.6250	12,850	13,726	1,465,568	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国	債	証	券	2.5000	5,690	6,945	741,603	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国	債	証	券	3.0000	6,460	8,703	929,255	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国	債	証	券	3.0000	6,600	8,936	954,128	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国	債	証	券	2.7500	11,930	13,013	1,389,400	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国	債	証	券	2.0000	12,140	13,081	1,396,743	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国	債	証	券	2.6250	7,260	8,487	906,259	2029/02/15
US T N/B 1.75 02/28/22	国	債	証	券	1.7500	10,500	10,774	1,150,425	2022/02/28
US T N/B 2.75 02/15/28	国	債	証	券	2.7500	6,640	7,726	824,988	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国	債	証	券	2.0000	9,070	9,499	1,014,251	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国	債	証	券	2.2500	6,690	7,454	795,876	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国	債	証	券	2.1250	3,330	3,559	380,043	2024/02/29
US T N/B 1.5 02/28/23	国	債	証	券	1.5000	7,620	7,884	841,872	2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/26	国	債	証	券	2.5000	5,520	6,168	658,621	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国	債	証	券	2.7500	6,290	7,000	747,451	2025/02/28
US T N/B 1.875 02/28/22	国	債	証	券	1.8750	2,440	2,508	267,845	2022/02/28
US T N/B 2.5 02/15/22	国	債	証	券	2.5000	7,160	7,429	793,290	2022/02/15
US T N/B 2.375 02/29/24	国	債	証	券	2.3750	5,800	6,251	667,452	2024/02/29
US T N/B 2.625 02/28/23	国	債	証	券	2.6250	1,370	1,458	155,759	2023/02/28
US T N/B 2.0 02/15/50	国	債	証	券	2.0000	7,850	8,871	947,234	2050/02/15
US T N/B 1.125 02/28/22	国	債	証	券	1.1250	10,000	10,158	1,084,591	2022/02/28
US T N/B 1.375 02/15/23	国	債	証	券	1.3750	2,870	2,958	315,922	2023/02/15
US T N/B 1.5 02/15/30	国	債	証	券	1.5000	11,550	12,437	1,327,995	2030/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国	債	証	券	1.1250	7,790	8,086	863,383	2025/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国	債	証	券	2.1250	3,400	3,638	388,485	2024/03/31
US T N/B 1.75 03/31/22	国	債	証	券	1.7500	5,290	5,436	580,433	2022/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23	国	債	証	券	1.5000	3,810	3,946	421,349	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国	債	証	券	2.6250	4,430	4,912	524,465	2025/03/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	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 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	1,450	1,601	170,999	2026/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	6,720	7,145	762,898	2023/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	2,740	2,761	294,823	2027/03/31	
US T N/B 0.375 03/31/22	国債証券	0.3750	14,270	14,317	1,528,726	2022/03/31	
US T N/B 0.5 03/15/23	国債証券	0.5000	7,000	7,055	753,272	2023/03/15	
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	4,220	4,736	505,728	2025/04/30	
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	2,060	2,197	234,620	2024/04/30	
US T N/B 1.875 04/30/22	国債証券	1.8750	10,390	10,711	1,143,660	2022/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	8,680	9,658	1,031,241	2026/04/30	
US T N/B 2.25 04/15/22	国債証券	2.2500	8,560	8,877	947,903	2022/04/15	
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	10,670	11,441	1,221,563	2023/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	8,000	8,608	919,089	2024/04/30	
US T N/B 0.125 04/30/22	国債証券	0.1250	5,670	5,663	604,711	2022/04/30	
US T N/B 0.25 04/15/23	国債証券	0.2500	8,130	8,139	869,074	2023/04/15	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	1,230	1,232	131,622	2025/04/30	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	1,210	1,860	198,601	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,840	2,884	307,976	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	3,150	4,968	530,500	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	2,310	3,045	325,139	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	690	1,059	113,096	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	8,730	11,297	1,206,198	2043/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	6,110	8,559	913,922	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	4,560	6,061	647,158	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	6,000	8,088	863,585	2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	5,890	7,225	771,502	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	6,660	9,229	985,468	2048/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	1,250	1,286	137,388	2022/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	8,200	10,963	1,170,589	2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	2,250	3,526	376,508	2038/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	20,000	20,890	2,230,492	2023/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	12,970	14,093	1,504,787	2024/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	7,190	7,814	834,308	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	13,300	15,655	1,671,543	2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	10,760	12,386	1,322,518	2029/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	8,430	9,489	1,013,212	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	890	1,451	154,965	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	14,030	15,002	1,601,788	2026/05/15	
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	1,460	1,520	162,326	2023/05/31	
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	6,910	7,378	787,811	2024/05/31	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	6,000	5,683	606,799	2050/05/15	
US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	1.7500	9,490	9,775	1,043,723	2022/05/31	
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	6,070	6,669	712,093	2026/05/31	
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,880	4,168	445,046	2023/05/31	
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	4,550	5,114	546,111	2025/05/31	
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	8,630	8,608	919,085	2023/05/15	
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	1,390	1,438	153,593	2023/06/30	
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	7,540	8,060	860,644	2024/06/30	
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	3,820	3,968	423,729	2022/06/30	
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	8,100	9,068	968,279	2025/06/30	
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	6,470	7,014	748,980	2026/06/30	
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	8,780	9,415	1,005,331	2023/06/30	
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	7,510	7,953	849,201	2024/06/30	
US T N/B 1.75 06/30/22	国債証券	1.7500	5,160	5,320	568,106	2022/06/30	
US T N/B 1.75 06/15/22	国債証券	1.7500	3,700	3,814	407,224	2022/06/15	
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	3,520	3,786	404,281	2024/07/31	

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 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	8,400	8,667	925,455		2023/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	2,990	3,371	359,945		2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/22	国債証券	1.8750	10,290	10,651	1,137,288		2022/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	10,070	10,858	1,159,339		2023/07/31
US T N/B 1.75 07/15/22	国債証券	1.7500	2,940	3,033	323,921		2022/07/15
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,200	1,427	152,437		2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	1,170	1,708	182,433		2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	930	1,295	138,277		2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,460	2,159	230,562		2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	4,000	5,075	541,924		2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	3,930	5,308	566,796		2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	2,510	3,971	423,993		2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	4,350	6,293	671,964		2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	6,340	8,269	882,906		2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	9,350	10,131	1,081,751		2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	8,980	11,608	1,239,391		2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	7,730	9,178	980,017		2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	6,700	7,179	766,607		2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	14,120	15,338	1,637,740		2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	4,060	4,759	508,127		2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	7,030	9,557	1,020,454		2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	9,290	10,407	1,111,230		2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	8,500	9,035	964,691		2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	10,270	12,130	1,295,187		2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	8,140	9,139	975,845		2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	9,500	9,848	1,051,559		2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	9,900	10,763	1,149,182		2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	7,320	7,806	833,517		2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	7,030	7,594	810,816		2023/08/31
US T N/B 1.625 08/31/22	国債証券	1.6250	3,280	3,382	361,122		2022/08/31
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	11,300	11,616	1,240,292		2022/08/15
US T N/B 1.5 08/31/21	国債証券	1.5000	13,560	13,773	1,470,592		2021/08/31
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	6,000	6,331	676,054		2026/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	7,430	8,451	902,380		2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	9,800	10,042	1,072,259		2021/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	9,000	9,338	997,039		2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	5,360	5,548	592,406		2022/09/30
US T N/B 1.125 09/30/21	国債証券	1.1250	430	435	46,463		2021/09/30
US T N/B 1.875 09/30/22	国債証券	1.8750	8,860	9,197	981,973		2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	7,810	8,484	905,925		2023/09/30
US T N/B 2.75 09/15/21	国債証券	2.7500	2,960	3,053	326,026		2021/09/15
US T N/B 1.5 09/15/22	国債証券	1.5000	8,410	8,653	923,926		2022/09/15
US T N/B 1.5 09/30/21	国債証券	1.5000	20,880	21,229	2,266,716		2021/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	820	878	93,789		2026/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	4,560	4,944	527,950		2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	6,560	7,472	797,812		2025/10/31
US T N/B 1.25 10/31/21	国債証券	1.2500	10,500	10,650	1,137,200		2021/10/31
US T N/B 2.875 10/15/21	国債証券	2.8750	13,100	13,559	1,447,695		2021/10/15
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	1,780	1,862	198,884		2023/10/31
US T N/B 2.0 10/31/22	国債証券	2.0000	4,280	4,461	476,325		2022/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	9,290	10,108	1,079,303		2023/10/31
US T N/B 1.5 10/31/21	国債証券	1.5000	9,100	9,262	988,951		2021/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	100	107	11,442		2026/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	2,100	2,328	248,661		2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,700	2,350	250,936		2028/11/15

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 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,050	2,884		308,003	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	4,400	5,833		622,872	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	1,040	1,612		172,199	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	4,620	5,856		625,344	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	2,350	3,152		336,591	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	4,190	6,179		659,795	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	4,650	6,015		642,244	2047/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	4,950	6,605		705,232	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	5,750	7,564		807,650	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	13,850	15,028		1,604,575	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	620	967		103,350	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	7,560	10,982		1,172,556	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	7,470	9,108		972,476	2049/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	7,900	8,099		864,734	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	3,890	4,279		456,868	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	9,770	11,782		1,258,046	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	20,000	20,678		2,207,886	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	13,330	14,457		1,543,663	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	8,900	9,750		1,041,046	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	12,020	12,544		1,339,422	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	12,060	13,543		1,446,087	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	3,970	4,288		457,853	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	6,780	7,685		820,552	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	9,810	10,689		1,141,353	2023/11/30
US T N/B 1.75 11/30/21	国債証券	1.7500	1,380	1,410		150,646	2021/11/30
US T N/B 2.875 11/15/21	国債証券	2.8750	8,440	8,754		934,755	2021/11/15
US T N/B 1.5 11/30/21	国債証券	1.5000	2,460	2,506		267,630	2021/11/30
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	310	332		35,482	2026/11/30
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	13,240	14,565		1,555,108	2029/11/15
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	1,510	1,590		169,775	2024/11/30
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	9,670	10,472		1,118,128	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	7,300	8,187		874,230	2025/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	7,000	7,201		768,935	2021/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	4,530	4,926		525,989	2024/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	13,500	14,150		1,510,874	2022/12/31
US T N/B 2.625 12/15/21	国債証券	2.6250	11,320	11,727		1,252,118	2021/12/15
US T N/B 1.625 12/31/21	国債証券	1.6250	3,070	3,137		334,998	2021/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	4,990	5,391		575,696	2026/12/31
US T N/B 1.625 12/15/22	国債証券	1.6250	8,600	8,903		950,610	2022/12/15
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	600	638		68,221	2024/12/31
小計	-	-	1,299,750	1,450,949		154,917,910	-
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		千円	
CANADA 1.5 02/01/22	国債証券	1.5000	3,050	3,112		243,895	2022/02/01
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	3,190	3,414		267,600	2024/03/01
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	4,170	4,188		328,257	2022/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	5,070	5,266		412,772	2023/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	2,060	2,145		168,161	2025/03/01
CANADA 1.5 05/01/22	国債証券	1.5000	1,580	1,616		126,699	2022/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	2,450	2,610		204,552	2026/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	920	1,393		109,241	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,230	1,794		140,602	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	1,860	3,019		236,676	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	1,950	3,228		253,025	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	3,600	3,905		306,037	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	2,450	3,874		303,637	2041/06/01

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		
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	3,350	3,511	275,225	2022/06/01	
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	3,130	3,238	253,807	2023/06/01	
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	1,060	1,187	93,029	2028/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,840	2,009	157,490	2025/06/01	
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	2,620	2,721	213,257	2027/06/01	
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	1,480	1,707	133,794	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	3,320	3,548	278,089	2030/06/01	
CANADA 0.25 08/01/22	国債証券	0.2500	1,600	1,598	125,254	2022/08/01	
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	1,410	1,478	115,836	2024/09/01	
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	3,080	3,244	254,235	2023/09/01	
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	3,180	3,230	253,194	2022/09/01	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	2,220	2,233	175,007	2025/09/01	
CANADA 1.25 11/01/21	国債証券	1.2500	4,300	4,360	341,742	2021/11/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	2,510	3,918	307,107	2045/12/01	
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	2,840	4,062	318,403	2048/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	1,790	2,267	177,694	2051/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	670	1,085	85,093	2064/12/01	
小計	-	-	73,980	84,974	6,659,420	-	
(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	2,120	2,705	197,131	2047/03/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	3,880	4,412	321,526	2025/04/21	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	5,540	7,088	516,479	2027/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	5,220	5,706	415,766	2024/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	5,200	6,327	461,034	2026/04/21	
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	7,140	8,196	597,173	2023/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	4,680	5,661	412,492	2029/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	2,890	4,111	299,544	2033/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	2,050	2,789	203,206	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	4,340	4,848	353,240	2028/05/21	
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	4,050	4,679	340,954	2030/05/21	
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	950	1,143	83,345	2041/05/21	
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	1,000	1,031	75,167	2032/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	1,370	1,763	128,484	2039/06/21	
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	3,520	3,730	271,794	2031/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	2,620	3,177	231,532	2035/06/21	
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	4,040	4,495	327,538	2022/07/15	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	5,590	6,497	473,413	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	4,270	4,914	358,059	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	3,430	4,021	292,994	2029/11/21	
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	5,730	6,005	437,561	2022/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	3,210	3,195	232,817	2024/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	4,500	4,540	330,846	2030/12/21	
小計	-	-	87,340	101,044	7,362,104	-	
(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	612	46,816	2024/02/01	
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	1,700	1,762	134,585	2023/02/01	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	1,130	1,336	102,060	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	1,100	1,437	109,811	2046/03/01	
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	330	374	28,582	2050/03/01	
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	730	935	71,425	2042/04/01	
SINGAPORE 1.75 04/01/22	国債証券	1.7500	1,740	1,784	136,335	2022/04/01	
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	1,020	1,161	88,697	2028/05/01	
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	920	1,001	76,523	2025/06/01	
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	570	619	47,337	2026/06/01	
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	1,070	1,254	95,784	2029/07/01	

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 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	470	560	42,785		2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	370	396	30,264		2023/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	510	588	44,913		2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	1,970	2,176	166,239		2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	1,670	1,772	135,373		2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	450	533	40,764		2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	1,100	1,411	107,837		2033/09/01
小計	-	-	17,430	19,719	1,506,137		-
(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	4,380	6,787	894,423		2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	3,190	5,190	684,039		2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	2,480	5,424	714,841		2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	2,720	3,452	454,969		2049/01/22
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	3,000	3,008	396,502		2023/01/31
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	2,780	3,433	452,458		2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	3,260	5,083	669,922		2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	6,690	6,952	916,202		2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	3,580	5,212	686,853		2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	2,080	2,143	282,503		2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	2,890	3,454	455,184		2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	2,280	4,304	567,265		2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	2,680	3,665	483,066		2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	2,670	4,651	613,001		2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	2,400	5,297	698,107		2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	2,390	2,607	343,570		2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	3,860	4,181	551,063		2027/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	2,680	2,710	357,210		2022/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	2,090	2,139	282,002		2023/07/22
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	1,930	3,192	420,721		2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	3,830	4,110	541,644		2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	2,500	2,792	367,995		2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	4,330	4,791	631,452		2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	3,320	5,160	680,108		2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	3,560	4,226	556,959		2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	7,000	7,277	958,998		2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	1,600	2,067	272,399		2054/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	1,920	2,841	374,423		2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	1,000	1,112	146,631		2041/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	3,240	3,648	480,862		2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	4,140	4,403	580,293		2029/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	1,450	2,161	284,810		2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	1,980	3,416	450,198		2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	3,310	5,937	782,397		2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	3,520	6,519	859,125		2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	4,020	8,589	1,131,981		2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	2,280	2,986	393,516		2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	3,360	5,665	746,572		2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	3,120	4,575	602,915		2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	1,930	3,747	493,893		2049/12/07
小計	-	-	121,440	168,926	22,261,093		-
(イスラエル)		%	千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル	千円		
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	4,670	8,253	255,103		2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,730	2,529	78,194		2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	6,700	7,393	228,526		2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	7,960	8,868	274,139		2023/03/31

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	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(イスラエル)		%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円		
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	5,210	5,588	172,741	2025/08/31	
小計	—	—	26,270	32,633	1,008,704	—	
(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	21,050	39,448	631,573	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	14,100	15,828	253,414	2025/11/15	
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	15,100	16,168	258,853	2023/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	16,390	17,476	279,794	2027/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	10,040	10,792	172,784	2029/11/15	
DENMARK 0.25 11/15/22	国債証券	0.2500	10,000	10,200	163,302	2022/11/15	
小計	—	—	86,680	109,914	1,759,723	—	
(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	8,270	8,769	96,908	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	2,870	3,106	34,331	2027/02/17	
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	11,760	12,937	142,956	2024/03/14	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	10,070	10,722	118,487	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	10,510	11,676	129,026	2028/04/26	
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	5,560	5,845	64,594	2023/05/24	
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	7,410	7,926	87,583	2030/08/19	
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	1,970	2,168	23,963	2029/09/06	
小計	—	—	58,420	63,153	697,851	—	
(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	7,780	11,889	134,113	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	11,710	12,491	140,907	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	17,950	20,397	230,087	2025/05/12	
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	10	10	121	2022/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	15,060	16,003	180,517	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	4,010	4,314	48,662	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	7,310	7,818	88,192	2029/11/12	
小計	—	—	63,830	72,925	822,600	—	
(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	38,727	182,795	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	62,560	65,532	309,315	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	48,201	56,763	267,925	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	2,315	2,606	12,301	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	43,175	47,701	225,150	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	57,079	58,835	277,702	2022/06/09	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	40,030	44,431	209,715	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	26,328	28,593	134,962	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	33,666	37,536	177,174	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	37,143	43,742	206,466	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	21,473	28,848	136,164	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	20,241	22,885	108,020	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	31,873	38,071	179,698	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	36,863	40,433	190,844	2023/12/07	
小計	—	—	499,011	554,711	2,618,237	—	
(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 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	3,500	3,893	97,176	2046/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	3,910	4,033	100,675	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,480	1,615	40,334	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	2,820	3,148	78,583	2030/04/15	
MALAYSIA 4.127 04/15/32	国債証券	4.1270	1,180	1,272	31,758	2032/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,340	1,406	35,097	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	5,540	6,383	159,324	2037/04/07	
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	4,580	4,802	119,860	2027/05/31	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	2,000	2,183	54,491	2031/06/30	

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
(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 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,190	2,330	58,166		2024/07/15
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	2,000	2,113	52,746		2034/07/05
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	5,000	5,122	127,860		2022/08/15
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	2,760	2,977	74,305		2029/08/15
MALAYSIA 3.8 08/17/23	国債証券	3.8000	3,700	3,857	96,279		2023/08/17
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国債証券	5.2480	1,480	1,727	43,111		2028/09/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	4,400	4,701	117,359		2025/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	3,470	4,079	101,830		2043/09/30
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	1,840	1,956	48,845		2024/09/30
MALAYSIA 3.795 09/30/22	国債証券	3.7950	1,790	1,850	46,196		2022/09/30
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,500	1,604	40,055		2026/11/30
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	1,050	1,190	29,704		2033/11/07
小計	-	-	57,530	62,250	1,553,765		-
(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	9,120	9,632	257,383		2023/01/25
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,800	2,469	65,980		2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	5,790	6,428	171,780		2028/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	4,840	5,029	134,397		2022/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	4,850	5,210	139,229		2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	6,060	6,594	176,209		2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	7,180	8,057	215,296		2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	6,230	6,791	181,476		2027/07/25
POLAND 0.7/25/22	国債証券	-	2,640	2,624	70,138		2022/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	8,690	9,769	261,047		2022/09/23
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	1,610	1,798	48,058		2023/10/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	4,360	4,903	131,014		2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	6,880	7,353	196,480		2024/10/25
小計	-	-	70,050	76,665	2,048,493		-
(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	1,400	1,880	224,517		2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	1,180	1,344	160,438		2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	1,210	1,383	165,180		2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	1,030	1,312	156,673		2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	1,400	1,568	187,273		2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0.8000	620	634	75,704		2022/03/15
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	770	943	112,676		2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	800	916	109,395		2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	1,680	2,078	248,154		2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	1,970	2,131	254,394		2028/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	1,700	1,827	218,152		2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	1,130	1,380	164,784		2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	2,770	2,817	336,308		2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	570	584	69,829		2027/05/15
IRISH 10/18/22	国債証券	0.0000	1,000	1,011	120,780		2022/10/18
小計	-	-	19,230	21,816	2,604,264		-
(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	714	85,267		2023/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	2,310	4,193	500,597		2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	2,700	4,641	554,101		2047/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	1,670	1,859	221,953		2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	3,020	4,393	524,415		2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	2,260	3,803	454,006		2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,000	1,343	160,407		2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,570	1,730	206,580		2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/22	国債証券	0.0000	5,190	5,239	625,462		2022/01/15

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 01/15/24	国債証券	0.0000	3,030	3,097	369,733	2024/01/15	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	3,420	3,670	438,098	2023/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	520	551	65,886	2026/07/15	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	850	901	107,572	2022/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	3,600	3,986	475,867	2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	2,630	2,739	327,008	2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,660	1,817	216,906	2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	3,670	3,984	475,660	2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	3,250	3,424	408,807	2029/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	3,700	3,799	453,488	2030/07/15	
小計	—	—	46,640	55,891	6,671,821	—	
(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	3,190	3,450	411,845	2022/03/28	
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	3,750	5,441	649,537	2028/03/28	
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	2,350	4,120	491,834	2041/03/28	
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	2,220	2,852	340,448	2026/03/28	
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	1,550	2,277	271,900	2032/03/28	
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	2,950	5,027	600,144	2035/03/28	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	1,670	2,931	349,991	2045/06/22	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	1,640	2,059	245,847	2047/06/22	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	1,550	2,011	240,076	2050/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	830	1,262	150,647	2057/06/22	
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	1,110	1,726	206,104	2066/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	3,770	4,080	487,139	2026/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	2,490	2,802	334,536	2024/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,610	1,792	213,991	2031/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	1,680	1,822	217,609	2023/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	3,390	3,595	429,186	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	2,440	2,425	289,487	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,400	1,535	183,260	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	1,420	1,986	237,175	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	1,930	2,459	293,545	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	2,430	2,581	308,191	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	1,930	2,077	248,003	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	1,000	1,192	142,340	2037/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	1,770	1,804	215,383	2030/06/22	
BELGIUM 4.25 09/28/21	国債証券	4.2500	4,480	4,753	567,470	2021/09/28	
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	1,350	1,499	179,003	2022/09/28	
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	950	990	118,254	2024/10/22	
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	2,030	2,078	248,161	2023/10/22	
小計	—	—	58,880	72,640	8,671,119	—	
(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	0.0000	2,810	2,837	338,733	2022/02/25	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	10,170	10,380	1,239,158	2024/03/25	
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	3,610	3,694	441,062	2025/03/25	
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	4,330	4,399	525,158	2023/03/25	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,480	1,864	222,606	2023/04/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	7,840	9,664	1,153,635	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	6,240	11,434	1,364,972	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	2,610	5,369	640,901	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	2,460	5,341	637,620	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	7,440	11,252	1,343,267	2029/04/25	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	13,130	14,004	1,671,705	2022/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	4,270	7,193	858,712	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	4,320	7,133	851,553	2045/05/25	

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 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	3,580	4,936	589,319	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	4,480	5,616	670,436	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	3,030	3,149	375,993	2052/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	2,070	2,947	351,896	2066/05/25	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	8,220	9,133	1,090,291	2024/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	5,550	7,017	837,707	2030/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	4,850	5,246	626,222	2028/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	7,930	9,308	1,111,201	2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	7,840	8,230	982,474	2025/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	6,690	7,115	849,381	2029/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	3,360	3,895	465,041	2034/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	12,820	13,530	1,615,127	2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	6,120	6,693	799,018	2027/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	9,570	10,225	1,220,579	2023/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	6,030	7,021	838,136	2036/05/25	
FRANCE OAT 05/25/22	国債証券	0.0000	5,500	5,564	664,177	2022/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	5,110	6,478	773,351	2039/06/25	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	10,990	12,785	1,526,217	2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,220	2,998	357,912	2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	4,800	5,901	704,415	2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	5,170	8,637	1,031,061	2038/10/25	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3.2500	4,090	4,301	513,412	2021/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	5,120	8,780	1,048,117	2032/10/25	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	5,090	5,431	648,406	2022/10/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	8,080	8,727	1,041,744	2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,630	2,737	326,732	2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	6,690	7,252	865,751	2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	8,900	9,032	1,078,197	2029/11/25	
小計	—	—	237,240	287,269	34,291,413	—	
(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	1,473	175,889	2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	3,440	5,073	605,572	2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	1,400	2,320	276,941	2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	4,320	7,074	844,438	2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	4,750	8,146	972,495	2037/01/04	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2.0000	8,030	8,364	998,493	2022/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	4,750	5,013	598,402	2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	6,250	6,663	795,444	2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	6,990	7,466	891,331	2029/02/15	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	5,050	5,347	638,353	2023/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	2,040	2,211	263,979	2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	4,200	4,579	546,646	2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	4,240	4,490	536,030	2027/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,350	1,409	168,307	2030/02/15	
BUNDESSCHAT 0.0 03/11/22	国債証券	0.0000	3,000	3,033	362,113	2022/03/11	
BUNDESUBL 04/08/22	国債証券	0.0000	3,300	3,339	398,659	2022/04/08	
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	2,960	3,018	360,366	2023/04/14	
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	5,380	5,520	659,020	2024/04/05	
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	2,000	2,064	246,418	2025/04/11	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	5,000	5,431	648,322	2024/05/15	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	8,090	8,610	1,027,856	2023/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	2,000	2,067	246,818	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,670	2,519	300,811	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,800	2,580	308,066	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	3,150	5,850	698,354	2039/07/04	

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 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	3,530	6,192	739,228		2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	4,660	7,582	905,080		2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	2,730	5,470	652,969		2040/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	4,380	4,597	548,763		2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	2,520	4,355	519,972		2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	5,810	9,697	1,157,624		2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	3,930	5,324	635,557		2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	4,870	5,294	631,948		2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	5,360	5,789	691,142		2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	5,690	5,917	706,394		2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	5,940	6,335	756,316		2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	3,880	4,212	502,843		2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	3,100	3,319	396,192		2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	5,620	5,876	701,431		2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	780	776	92,658		2050/08/15
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	3,300	3,461	413,151		2022/09/04
BUNDESSCHAT 0.0 09/10/21	国債証券	0.0000	1,070	1,078	128,725		2021/09/10
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	4,040	4,158	496,344		2024/10/18
BUNDESUBL 10/08/21	国債証券	0.0000	3,400	3,428	409,218		2021/10/08
BUNDESUBL 10/07/22	国債証券	0.0000	3,000	3,047	363,736		2022/10/07
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	4,800	4,910	586,217		2023/10/13
BUNDESSCHAT 0.0 12/10/21	国債証券	0.0000	40	40	4,821		2021/12/10
小計	-	-	178,790	214,538	25,609,478		-
(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	4,579	546,625		2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	3,500	5,188	619,345		2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	3,000	3,546	423,372		2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	4,460	6,776	808,954		2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	3,740	4,298	513,116		2023/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,810	1,959	233,941		2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	5,600	6,469	772,277		2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	3,700	4,046	483,009		2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	5,990	6,674	796,750		2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	2,010	2,192	261,715		2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	5,320	5,834	696,472		2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	3,300	3,349	399,782		2022/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	2,530	2,549	304,275		2030/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	1,860	1,873	223,604		2023/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	4,440	6,025	719,210		2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	2,300	3,920	467,972		2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	3,800	6,425	767,035		2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,960	3,198	381,792		2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	4,820	5,985	714,468		2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	2,620	3,009	359,293		2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	4,820	7,738	923,731		2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	3,400	4,109	490,601		2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	2,460	2,683	320,313		2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	2,770	3,183	379,995		2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	2,450	2,493	297,606		2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	3,300	3,361	401,312		2023/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	3,930	4,428	528,640		2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	4,410	6,173	736,885		2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	2,440	4,499	537,119		2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	2,990	4,120	491,878		2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	3,230	4,334	517,402		2048/10/31

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 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	690	638	76,221	2050/10/31	
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	4,650	5,196	620,347	2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	6,450	7,039	840,304	2027/10/31	
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	4,720	4,819	575,252	2029/10/31	
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	4,080	4,721	563,623	2023/10/31	
SPAIN 0.05 10/31/21	国債証券	0.0500	6,080	6,115	729,960	2021/10/31	
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	3,040	3,098	369,864	2022/10/31	
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	2,000	2,151	256,764	2030/10/31	
小計	—	—	138,830	168,809	20,150,842	—	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	2,000	1,980	236,436	2027/01/15	
ITALY BTPS 0.05 01/15/23	国債証券	0.0500	3,180	3,166	378,025	2023/01/15	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	6,440	9,446	1,127,668	2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	4,390	5,683	678,467	2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	3,290	3,501	417,950	2028/02/01	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	3,340	3,650	435,814	2047/03/01	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	2,150	2,665	318,162	2048/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	3,500	4,010	478,741	2024/03/01	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	1,600	1,725	205,927	2067/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	8,750	10,485	1,251,613	2025/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	4,810	5,214	622,399	2022/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	3,500	4,202	501,646	2026/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	4,320	4,395	524,725	2032/03/01	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	2,130	2,495	297,869	2040/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	3,370	4,055	484,065	2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	4,660	5,578	665,852	2030/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	2,700	2,752	328,583	2023/03/15	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	5,000	5,094	608,118	2023/03/01	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	3,070	2,937	350,634	2036/03/01	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	3,000	3,067	366,121	2022/04/15	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	2,700	2,753	328,661	2022/04/01	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	4,220	4,233	505,404	2030/04/01	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	4,300	6,247	745,811	2031/05/01	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	4,430	4,961	592,239	2023/05/01	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	2,800	2,940	350,981	2024/05/15	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	3,300	3,436	410,229	2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	2,550	2,644	315,635	2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	2,500	2,693	321,552	2027/06/01	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	国債証券	0.6000	2,000	2,017	240,840	2023/06/15	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	90	96	11,478	2026/07/15	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	4,140	4,333	517,269	2024/07/01	
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	国債証券	1.0000	3,050	3,104	370,604	2022/07/15	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,800	2,530	302,101	2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	2,660	3,918	467,808	2039/08/01	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	2,240	2,544	303,780	2023/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	5,700	6,081	725,903	2027/08/01	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	4,400	5,061	604,136	2029/08/01	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	3,000	3,047	363,803	2022/08/01	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	2,130	2,427	289,752	2038/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	2,590	3,815	455,468	2044/09/01	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	3,850	4,606	549,932	2046/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	4,840	6,190	738,927	2028/09/01	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	2,910	4,297	512,991	2040/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	2,210	2,274	271,537	2050/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	3,650	3,998	477,330	2033/09/01	

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)							
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	千ユーロ 6,380	千ユーロ 7,204	千円 859,955	2024/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	960	1,273	151,983	2049/09/01	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	2,960	3,306	394,688	2022/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	2,400	2,549	304,336	2036/09/01	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	4,140	4,257	508,196	2022/09/15	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	1,870	1,888	225,469	2023/10/15	
ITALY BTPS 2.3 10/15/21	国債証券	2.3000	3,300	3,403	406,220	2021/10/15	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	3,030	3,235	386,212	2023/10/01	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,700	2,188	261,250	2023/11/01	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	2,150	2,982	356,018	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	3,400	4,685	559,272	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	2,850	3,839	458,323	2029/11/01	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	3,200	3,597	429,422	2022/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	2,800	2,899	346,135	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	3,430	3,732	445,560	2025/11/15	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	国債証券	0.3500	5,800	5,832	696,239	2021/11/01	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	2,900	3,082	368,007	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	3,500	3,565	425,621	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	5,290	5,712	681,959	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	10,110	11,415	1,362,634	2028/12/01	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国債証券	2.1500	2,010	2,074	247,673	2021/12/15	
小計	—	—	227,440	259,095	30,928,195	—	
(ユーロ…フィンランド)							
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	千ユーロ 1,200	千ユーロ 1,319	千円 157,531	2024/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	610	671	80,153	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	760	990	118,244	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	520	549	65,576	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	1,510	1,746	208,530	2034/04/15	
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	890	942	112,523	2023/04/15	
FINLAND 04/15/22	国債証券	0.0000	610	616	73,609	2022/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	360	363	43,423	2036/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	1,440	1,773	211,659	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	1,180	1,474	176,024	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	950	1,464	174,859	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	880	940	112,286	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	780	836	99,867	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	300	319	38,193	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	1,160	1,232	147,182	2027/09/15	
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	780	819	97,774	2022/09/15	
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	470	478	57,169	2023/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	350	358	42,754	2024/09/15	
小計	—	—	14,750	16,900	2,017,364	—	
(ユーロ…オーストリア)							
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	千ユーロ 660	千ユーロ 1,508	千円 180,026	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	1,450	1,898	226,609	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	2,840	3,026	361,316	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	1,000	1,082	129,243	2028/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	440	447	53,469	2030/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	1,700	2,225	265,647	2026/03/15	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	2,420	4,046	482,999	2037/03/15	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	760	847	101,199	2051/03/20	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	2,300	2,440	291,360	2027/04/20	
AUSTRIA 0.0 04/20/23	国債証券	0.0000	1,000	1,016	121,306	2023/04/20	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	1,890	2,516	300,408	2034/05/23	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	980	1,652	197,270	2044/06/20	

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 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	1,160	1,705	203,584	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	850	864	103,224	2023/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	2,670	2,729	325,831	2024/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	4,840	5,081	606,580	2021/09/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	920	1,791	213,823	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	1,990	2,183	260,637	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,150	1,236	147,585	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	1,470	1,604	191,533	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	870	938	111,989	2023/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	400	594	70,996	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	2,460	2,699	322,278	2022/11/22
小計	—	—	36,220	44,139	5,268,925	—
合計	—	—	—	—	339,429,470	—

■投資信託財産の構成

2020年6月22日現在

項目	当期		末
	評価額	比率	
公社債	千円	%	
コール・ローン等、その他	339,429,470	97.4	
投資信託財産総額	8,905,596	2.6	
	348,335,066	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、332,599,241千円、95.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.77円、1カナダ・ドル=78.37円、1オーストラリア・ドル=72.86円、1シンガポール・ドル=76.38円、1イギリス・ポンド=131.78円、1イスラエル・シェケル=30.91円、1デンマーク・クローネ=16.01円、1ノルウェー・クローネ=11.05円、1スウェーデン・クローナ=11.28円、1メキシコ・ペソ=4.72円、1マレーシア・リングギット=24.96円、1ポーランド・ズロチ=26.72円、1ユーロ=119.37円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	701,472,219,144円
コ ー ル ・ 公 社 債(評価額)	4,346,338,416
未 収 入 金	339,429,470,073
未 収 利 息	355,602,829,692
前 払 費 用	1,728,853,325
(B) 負 債	364,138,906,795
未 払 金	364,127,483,795
未 払 解 約 金	11,423,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	337,333,312,349
元 本	230,136,350,831
次 期 繰 越 損 益 金	107,196,961,518
(D) 受 益 権 総 口 数	230,136,350,831口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	14,658円

(注1) 期首元本額 327,518,238,620円
 追加設定元本額 372,741,135,596円
 一部解約元本額 470,123,023,385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>	4,983,783,965円
たわらノーロード バランス (堅実型)	225,731,910円
たわらノーロード バランス (標準型)	539,927,280円
たわらノーロード バランス (積極型)	248,963,737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)	11,596,633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)	467,334,517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)	480,337,957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)	114,574,770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)	16,420,708円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	3,363,911円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	6,566,503円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	12,882,283円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,354,359円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,675,587円
投資のソムリエ	81,297,161,086円
投資のソムリエ<DC年金>	7,880,337,302円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,151,910,141円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	57,262,511,436円
ワールドアセットバランス (基本コース)	3,425,326,635円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	2,310,540,584円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	64,579,720円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	37,901,657円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	59,725,579円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	142,207,741円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	24,972,939,068円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,121,493,462円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	18,373,264円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	7,480,327円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	8,102,360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)	19,976,339,042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)	5,943,085,380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)	530,035,974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)	60,913,162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)	428,836,613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)	966,109,573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)	1,102,111,668円
DIAMバランス20VA (適格機関投資家限定)	17,897,159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)	2,045,914,615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)	2,183,735,880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)	2,887,293,805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)	115,973,478円
期末元本合計	230,136,350,831円

■損益の状況

当期 自2019年6月25日 至2020年6月22日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	9,339,834,419円
受 取 利 息	9,344,843,727
そ の 他 収 益 金	70,369
支 払 利 息	△5,079,677
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	15,747,720,457
売 買 益	72,957,092,108
売 買 損	△57,209,371,651
(C) そ の 他 費 用	△43,341,345
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	25,044,213,531
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	127,340,088,329
(F) 解 約 差 損 益 金	△205,679,366,746
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	160,492,026,404
(H) 合 計(D + E + F + G)	107,196,961,518
次 期 繰 越 損 益 金(H)	107,196,961,518

(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。