

## 運用報告書 (全体版)

第5期<決算日2021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、2021年10月12日に第5期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

## 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)	税込み 分配金	期騰落 中率	期騰落 中率	期騰落 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
5期 (2021年10月12日)	10,194	0	△3.8	413.63	△3.5	100.3	-	10,224

(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 比	債券先物 比率
	円	騰 落 率	ポイ ント	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 10 月 12 日	10,596	% -	ポイ ント 428.67	% -	% 99.1	% -
10 月 末	10,616	0.2	429.55	0.2	96.9	-
11 月 末	10,625	0.3	429.92	0.3	99.7	-
12 月 末	10,612	0.2	429.65	0.2	98.7	-
2021 年 1 月 末	10,546	△0.5	427.12	△0.4	99.2	-
2 月 末	10,230	△3.5	414.29	△3.4	100.9	-
3 月 末	10,210	△3.6	413.65	△3.5	100.1	-
4 月 末	10,197	△3.8	413.35	△3.6	98.6	-
5 月 末	10,216	△3.6	414.03	△3.4	98.6	-
6 月 末	10,251	△3.3	415.77	△3.0	97.6	-
7 月 末	10,427	△1.6	423.02	△1.3	97.4	-
8 月 末	10,428	△1.6	423.13	△1.3	98.5	-
9 月 末	10,262	△3.2	416.47	△2.8	90.9	-
(期 末) 2021 年 10 月 12 日	10,194	△3.8	413.63	△3.5	100.3	-

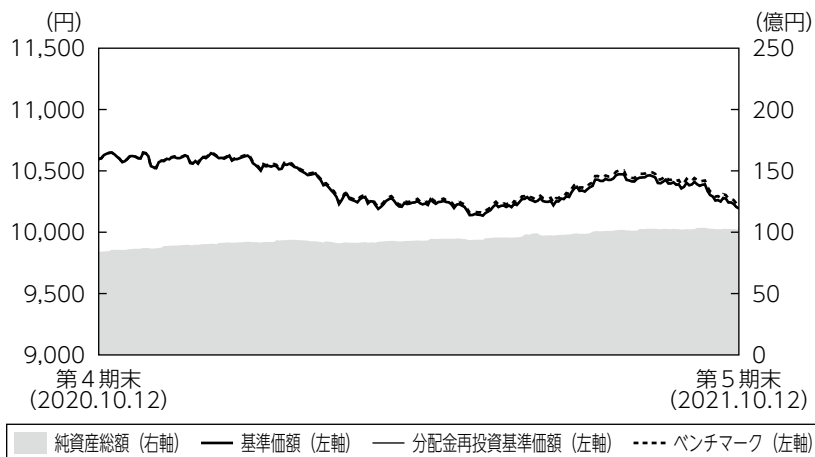
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

### 基準価額等の推移



第5期首：10,596円  
第5期末：10,194円  
(既払分配金0円)  
騰落率：△3.8%  
(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ワクチン普及に伴う景気回復や、FOMC（米連邦公開市場委員会）で早期にテーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）が開始される可能性が示されたことから米国債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドイツ債についても、ECB（欧州中央銀行）が資産買い入れペースを減速させるとの見方などを受けて利回りは上昇しました。これらを受けて基準価額は下落しました。

## 投資環境

外国債券市場では、米国債やドイツ国債の利回りは上昇する展開となりました。新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により景気回復が加速するとの見方、FOMCで早期にテーパリングが開始される可能性が示されたことから債券は売ら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。

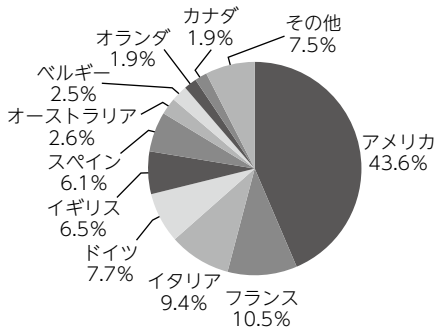
### ●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

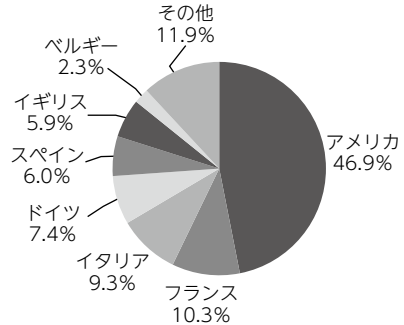
### 【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

#### ○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。

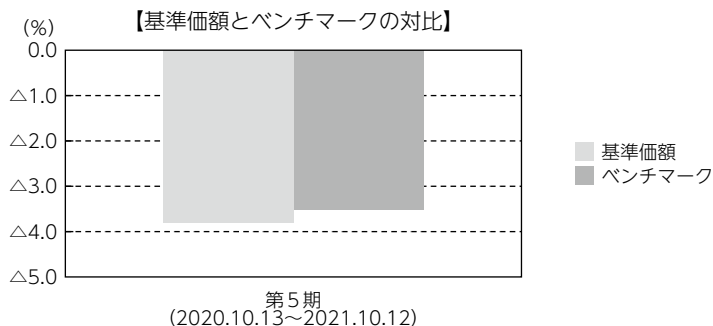
(注3) 期首（前期末）は上位11位以下、期末は上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

(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3.5%下落しました。

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



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

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

## ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年10月13日 ～2021年10月12日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	1,045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5期		項目の概要
	(2020年10月13日 ～2021年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	23円	0.220%	(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10,394円です。
(投信会社)	(10)	(0.096)	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)	(0.096)	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	0.017	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	( 1)	(0.012)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	( 0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	( 0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	25	0.236	

(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。

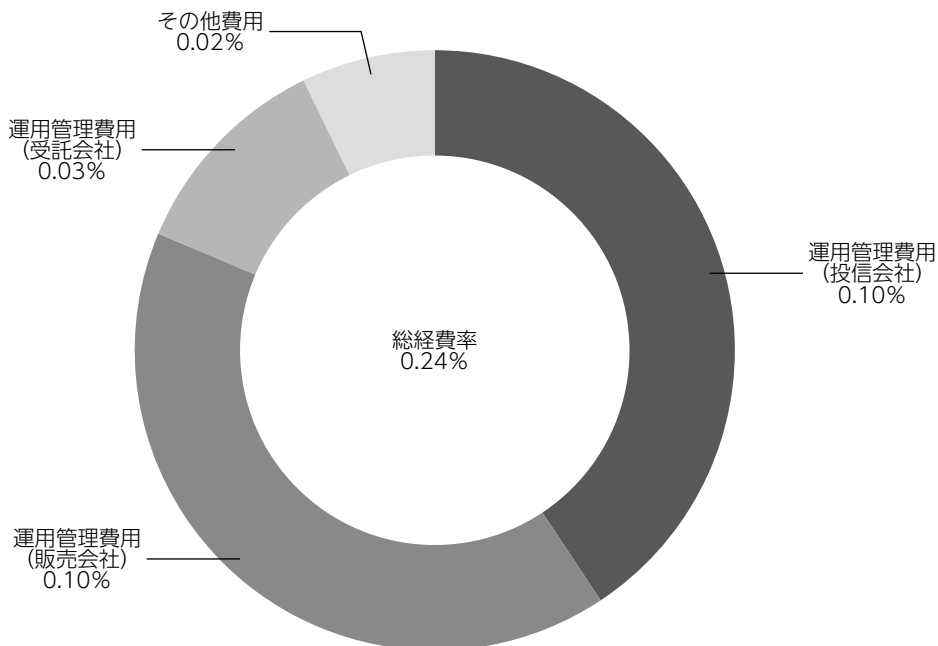
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.24%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（2020年10月13日から2021年10月12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	1,905,301	2,772,441	428,375	620,339

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021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
	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	5,693,414	7,170,339	10,223,470

## ■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	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	10,223,470	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	23,278	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	10,246,749	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、2021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528,845,695千円、99.5%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、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円、1カナダ・ドル=90.84円、1オーストラリア・ドル=83.31円、1シンガポール・ドル=83.70円、1イギリス・ポンド=154.20円、1イスラエル・シケル=35.165円、1デンマーク・クローネ=17.62円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=5.436円、1マレーシア・リンギット=27.173円、1ポーランド・ズロチ=28.559円、1ユーロ=131.12円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,246,749,095円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	22,161,520
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)	10,223,470,575
未 収 入 金	1,117,000
(B) 負 債	22,722,537
未 払 解 約 金	11,625,682
未 払 信 託 報 酬	10,917,358
そ の 他 未 払 費 用	179,497
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	10,224,026,558
元 本	10,029,618,972
次 期 繰 越 損 益 金	194,407,586
(D) 受 益 権 総 口 数	10,029,618,972口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,194円

(注) 期首における元本額は7,946,124,217円、当期中における追加設定元本額は4,677,216,617円、同解約元本額は2,593,721,862円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△4,178円
受 取 利 息	632
支 払 利 息	△4,810
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△302,795,288
売 買 益 損	42,266,800
買 入 損 益	△345,062,088
(C) 信 託 報 酬 等	△21,202,890
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△324,002,356
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	290,085,816
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	228,324,126
(配 当 等 相 当 額)	(611,733,222)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△383,409,096)
(G) 合 計 (D+E+F)	194,407,586
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	194,407,586
追 加 信 託 差 損 益 金	228,324,126
(配 当 等 相 当 額)	(615,490,681)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△387,166,555)
分 配 準 備 積 立 金	433,029,695
繰 越 損 益 金	△466,946,235

(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	142,943,879円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	615,490,681
(d) 分 配 準 備 積 立 金	290,085,816
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	1,048,520,376
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,045.42
(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。

## 《お知らせ》

- 当ファンドが投資対象とする「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」において、信託金の限度額を1兆円から5兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年1月8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 運用報告書

第14期（決算日 2021年6月22日）

（計算期間 2020年6月23日～2021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14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 (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	債券先物 率	純資産 総額
	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
10期 (2017年6月22日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
11期 (2018年6月22日)	13,477	△1.1	387.96	△0.9	97.9	-	177,029
12期 (2019年6月24日)	13,246	△1.7	381.67	△1.6	98.0	-	290,732
13期 (2020年6月22日)	13,888	4.8	400.89	5.0	96.9	-	454,858
14期 (2021年6月22日)	14,658	5.5	424.77	6.0	100.6	-	337,333
	14,333	△2.2	415.85	△2.1	97.9	-	573,974

(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）。

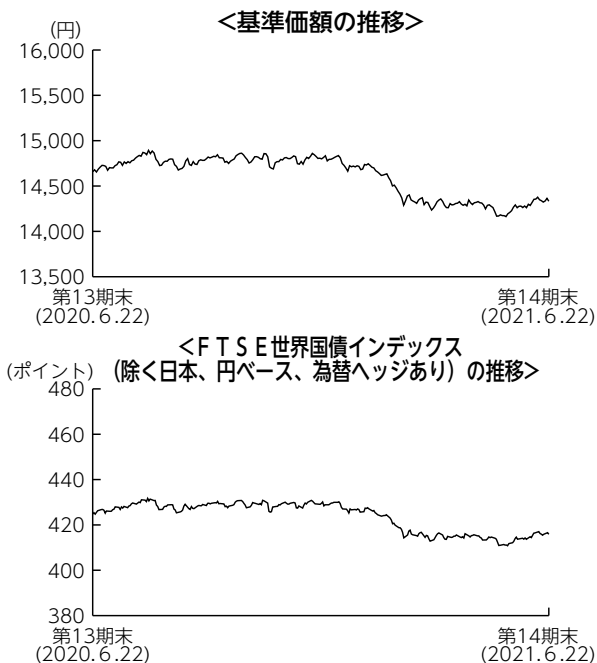
## ■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2020 年 6 月 22 日	円 14,658	% -	ポイント 424.77	% -	% 100.6	% -
6 月 末	14,726	0.5	426.81	0.5	99.1	-
7 月 末	14,871	1.5	431.07	1.5	99.4	-
8 月 末	14,688	0.2	425.73	0.2	94.1	-
9 月 末	14,845	1.3	430.39	1.3	97.8	-
10 月 末	14,817	1.1	429.55	1.1	96.9	-
11 月 末	14,832	1.2	429.92	1.2	99.7	-
12 月 末	14,817	1.1	429.65	1.2	98.7	-
2021 年 1 月 末	14,727	0.5	427.12	0.6	99.2	-
2 月 末	14,289	△2.5	414.29	△2.5	100.9	-
3 月 末	14,263	△2.7	413.65	△2.6	100.1	-
4 月 末	14,248	△2.8	413.35	△2.7	98.6	-
5 月 末	14,277	△2.6	414.03	△2.5	98.6	-
(期 末) 2021 年 6 月 22 日	14,333	△2.2	415.85	△2.1	97.9	-

(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（2020年6月23日から2021年6月22日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は14,333円となり、前期末比で2.2%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチンの普及や追加経済対策により米国の景気回復が加速するとの見方や、F R B（米連邦準備理事会）は金利上昇をさほど警戒していないとの見方、インフレ加速観測の高まりなどを背景に、米国債やドイツ国債の利回りが上昇（価格は下落）したことが基準価額の下落要因となりました。

### 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上昇する展開となりました。米国債は、新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により米国の景気回復が加速するとの見方や、F R Bは金利上昇をさほど警戒していないとの見方、インフレ加速観測の高まりなどを背景に利回りは上昇しました。ドイツ国債についても、リスク選好の動きやイタリアの政局を巡る不透明感の後退、米金利上昇などを受けて利回りは上昇しました。

### 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2.1%下落しました。

当ファンドはベンチマークを0.1%下回りました。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		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) その他費用 (保管費用)	2円	0.012%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(0)	(0.001)	
合 計	2	0.012	
期中の平均基準価額は14,607円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ■ 売買及び取引の状況 (2020年6月23日から2021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 3,251,768	千アメリカ・ドル 2,326,770 (-)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 186,546	千カナダ・ドル 135,120 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 244,837	千オーストラリア・ドル 194,652 (-)
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 36,086	千シンガポール・ドル 26,028 (-)
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 360,190	千イギリス・ポンド 267,969 (-)
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シュケル 102,748	千イスラエル・シュケル 57,560 (-)
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 197,936	千デンマーク・クローネ 148,890 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 130,127	千ノルウェー・クローネ 81,868 (-)
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 187,335	千スウェーデン・クローナ 107,417 (-)
メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 1,013,645	千メキシコ・ペソ 732,853 (-)	
国				

			買 付 額	売 付 額		
外	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リングgit 112,621	千マレーシア・リングgit 71,320 (-)		
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 162,423	千ポーランド・ズロチ 116,429 (-)		
国	ユ	アイルランド	千ユーロ 48,144	千ユーロ 33,160 (-)		
		オランダ	国債証券	112,226	81,970 (-)	
	ベルギー	国債証券	145,254	111,715 (-)		
	I	フランス	国債証券	649,452	481,045 (-)	
		ドイツ	国債証券	480,601	356,831 (-)	
		スペイン	国債証券	371,387	278,485 (-)	
		O	イタリア	国債証券	584,798	440,118 (-)
			フィンランド	国債証券	35,123	24,494 (-)
			オーストリア	国債証券	85,246	62,339 (-)

(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 (2020年6月23日から2021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 B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 2,200,010	千アメリカ・ドル 2,281,074	千円 251,556,942	% 43.8	% -	% 19.2	% 17.7	% 6.9
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 123,980	千カナダ・ドル 129,214	千円 11,506,558	2.0	-	0.9	0.6	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 134,710	千オーストラリア・ドル 143,827	千円 11,930,532	2.1	-	1.5	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 26,130	千シンガポール・ドル 28,519	千円 2,338,281	0.4	-	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 199,470	千イギリス・ポンド 241,090	千円 36,983,218	6.4	-	4.9	1.1	0.5
イスラエル	千イスラエル・シケル 66,430	千イスラエル・シケル 74,122	千円 2,502,978	0.4	-	0.2	0.2	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 125,820	千デンマーク・クローネ 150,861	千円 2,664,210	0.5	-	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 104,570	千ノルウェー・クローネ 106,983	千円 1,373,665	0.2	-	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 136,140	千スウェーデン・クローナ 148,585	千円 1,918,241	0.3	-	0.2	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 755,616	千メキシコ・ペソ 803,301	千円 4,315,898	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 96,580	千マレーシア・リングギット 100,624	千円 2,678,100	0.5	-	0.3	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 114,790	千ポーランド・ズロチ 119,136	千円 3,453,567	0.6	-	0.3	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	32,020	35,650	4,680,950	0.8	-	0.6	0.2	0.1
オランダ	71,370	83,111	10,912,566	1.9	-	1.4	0.5	0.0
ベルギー	85,610	101,871	13,375,741	2.3	-	1.8	0.5	0.0
フランス	377,300	436,996	57,377,617	10.0	-	6.4	2.6	1.0
ドイツ	285,290	327,715	43,029,089	7.5	-	4.6	1.9	1.0
スペイン	220,030	255,804	33,587,121	5.9	-	3.9	1.5	0.5
イタリア	358,000	408,439	53,628,139	9.3	-	5.6	2.7	1.0
フィンランド	24,760	26,709	3,507,000	0.6	-	0.3	0.2	0.0
オーストリア	55,480	63,858	8,384,606	1.5	-	0.9	0.5	0.1
合 計	-	-	千円 561,705,029	97.9	-	53.8	31.9	12.2

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

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

(B) 個別銘柄開示  
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当			期			末
	種	類	利 率	評 価 額		償 還 年 月 日	
			額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)			%				
US T N/B 2.625 01/31/26	国	債 証 券	2.6250	7,280	7,874	868,413	2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国	債 証 券	2.5000	5,160	5,509	607,633	2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国	債 証 券	2.2500	8,160	8,556	943,578	2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国	債 証 券	1.7500	8,180	8,380	924,149	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国	債 証 券	2.5000	10,820	11,417	1,259,136	2024/01/31
US T N/B 2.375 01/31/23	国	債 証 券	2.3750	5,560	5,755	634,665	2023/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24	国	債 証 券	0.1250	13,000	12,918	1,424,623	2024/01/15
US T N/B 1.5 01/15/23	国	債 証 券	1.5000	8,000	8,165	900,470	2023/01/15
US T N/B 1.5 01/31/27	国	債 証 券	1.5000	6,020	6,183	681,883	2027/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国	債 証 券	1.3750	7,340	7,540	831,525	2025/01/31
US T N/B 0.125 01/31/23	国	債 証 券	0.1250	11,630	11,616	1,281,053	2023/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国	債 証 券	0.7500	15,270	14,847	1,637,337	2028/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国	債 証 券	0.3750	14,420	14,118	1,556,941	2026/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国	債 証 券	6.0000	1,810	2,238	246,841	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国	債 証 券	3.1250	4,040	4,797	529,103	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国	債 証 券	3.1250	4,760	5,654	623,562	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国	債 証 券	2.5000	6,270	6,751	744,503	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国	債 証 券	3.5000	2,390	2,976	328,267	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国	債 証 券	5.3750	2,290	3,109	342,864	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国	債 証 券	4.5000	1,910	2,614	288,322	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国	債 証 券	4.7500	3,470	5,065	558,670	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国	債 証 券	3.6250	5,280	6,786	748,455	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国	債 証 券	3.0000	10,860	12,911	1,423,929	2049/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国	債 証 券	4.3750	1,890	2,592	285,857	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国	債 証 券	4.6250	2,790	3,986	439,623	2040/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国	債 証 券	1.8750	20,240	19,171	2,114,186	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国	債 証 券	1.6250	12,800	13,260	1,462,423	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国	債 証 券	2.5000	9,670	10,398	1,146,721	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国	債 証 券	3.0000	8,500	10,030	1,106,108	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国	債 証 券	3.0000	10,760	12,737	1,404,699	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国	債 証 券	2.7500	16,470	17,499	1,929,831	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国	債 証 券	2.0000	11,220	11,780	1,299,160	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国	債 証 券	2.6250	14,530	15,918	1,755,532	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国	債 証 券	2.7500	15,000	16,515	1,821,300	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国	債 証 券	2.0000	14,780	15,226	1,679,218	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国	債 証 券	2.2500	13,150	14,049	1,549,372	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国	債 証 券	2.1250	8,810	9,217	1,016,463	2024/02/29
US T N/B 1.5 02/28/23	国	債 証 券	1.5000	7,620	7,781	858,157	2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/26	国	債 証 券	2.5000	5,520	5,940	655,091	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国	債 証 券	2.7500	6,290	6,777	747,419	2025/02/28
US T N/B 2.375 02/29/24	国	債 証 券	2.3750	5,800	6,107	673,504	2024/02/29
US T N/B 2.625 02/28/23	国	債 証 券	2.6250	5,370	5,585	615,961	2023/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国	債 証 券	1.1250	24,380	23,616	2,604,396	2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国	債 証 券	1.8750	16,620	16,175	1,783,810	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国	債 証 券	2.0000	13,510	13,165	1,451,937	2050/02/15
US T N/B 1.375 02/15/23	国	債 証 券	1.3750	7,680	7,829	863,426	2023/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国	債 証 券	1.1250	3,840	3,862	425,973	2027/02/28
US T N/B 0.125 02/28/23	国	債 証 券	0.1250	20,510	20,481	2,258,662	2023/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国	債 証 券	1.5000	16,730	16,860	1,859,398	2030/02/15
US T N/B 0.125 02/15/24	国	債 証 券	0.1250	16,350	16,238	1,790,822	2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国	債 証 券	1.1250	7,790	7,931	874,719	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国	債 証 券	1.1250	14,380	14,315	1,578,702	2028/02/29

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 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	16,930	16,658		1,837,138	2026/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	13,170	13,791		1,520,922	2024/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	7,740	7,910		872,405	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	4,430	4,755		524,417	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	7,630	8,130		896,655	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	6,720	6,990		770,956	2023/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	6,260	6,118		674,711	2027/03/31
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	20,260	20,173		2,224,759	2024/03/15
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	11,090	11,031		1,216,555	2025/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	14,120	14,155		1,561,046	2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	16,930	16,844		1,857,632	2026/03/31
US T N/B 0.5 03/15/23	国債証券	0.5000	7,000	7,034		775,744	2023/03/15
US T N/B 0.125 03/31/23	国債証券	0.1250	15,000	14,972		1,651,162	2023/03/31
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	6,920	7,507		827,914	2025/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	6,860	7,164		790,150	2024/04/30
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	8,000	8,200		904,364	2023/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	4,280	4,585		505,665	2026/04/30
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	7,660	8,011		883,484	2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	8,000	8,412		927,730	2024/04/30
US T N/B 0.25 04/15/23	国債証券	0.2500	8,130	8,132		896,821	2023/04/15
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	8,000	8,016		884,066	2028/04/30
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	20,340	20,308		2,239,590	2024/04/15
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	7,490	7,254		800,055	2027/04/30
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	15,000	14,916		1,645,024	2026/04/30
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	11,870	11,738		1,294,501	2025/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	2,000	2,817		310,765	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	2,770	3,854		425,052	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	3,500	4,892		539,557	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	3,270	3,808		419,948	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	3,000	4,086		450,640	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	9,540	10,905		1,202,689	2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	6,000	7,439		820,457	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	4,120	4,829		532,605	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	6,010	7,096		782,627	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	6,280	6,765		746,069	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	9,900	11,996		1,323,005	2048/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	12,110	10,385		1,145,339	2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	11,490	13,360		1,473,419	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	2,140	2,976		328,250	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	10,000	10,289		1,134,763	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	15,300	16,211		1,787,796	2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	10,360	10,937		1,206,230	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	17,170	19,058		2,101,719	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	13,450	14,491		1,598,103	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	15,900	17,093		1,885,029	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	1,450	2,106		232,250	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	13,210	13,685		1,509,209	2026/05/15
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	5,460	5,605		618,169	2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	8,440	8,822		972,938	2024/05/31
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	14,140	11,452		1,263,020	2050/05/15
US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	1.7500	2,220	2,255		248,685	2022/05/31
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	7,070	7,495		826,612	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	6,000	6,078		670,390	2031/05/15
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	7,220	7,569		834,757	2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	4,550	4,939		544,718	2025/05/31

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 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	9,610	9,294	1,024,975		2027/05/31
US T N/B 0.125 05/31/22	国債証券	0.1250	8,000	8,002	882,532		2022/05/31
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	8,630	8,610	949,597		2023/05/15
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	5,000	4,971	548,233		2024/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	20,990	19,572	2,158,484		2030/05/15
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	8,970	8,816	972,248		2025/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	8,960	9,161	1,010,379		2023/06/30
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	6,710	7,018	774,000		2024/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	3,820	3,899	430,089		2022/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	5,150	5,567	613,976		2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	4,920	5,154	568,456		2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	8,780	9,197	1,014,326		2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	6,760	7,020	774,235		2024/06/30
US T N/B 1.75 06/30/22	国債証券	1.7500	5,160	5,247	578,669		2022/06/30
US T N/B 1.75 06/15/22	国債証券	1.7500	3,700	3,759	414,650		2022/06/15
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	10,800	10,434	1,150,687		2027/06/30
US T N/B 0.25 06/15/23	国債証券	0.2500	12,910	12,908	1,423,603		2023/06/15
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	8,990	8,826	973,331		2025/06/30
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	6,170	6,482	714,874		2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	8,400	8,573	945,458		2023/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	5,270	5,729	631,824		2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	5,000	5,238	577,720		2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	8,000	8,314	916,909		2024/07/31
US T N/B 1.875 07/31/22	国債証券	1.8750	3,950	4,026	444,088		2022/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	8,860	9,322	1,028,034		2023/07/31
US T N/B 1.75 07/15/22	国債証券	1.7500	2,940	2,991	329,903		2022/07/15
US T N/B 0.125 07/31/22	国債証券	0.1250	11,110	11,111	1,225,378		2022/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	9,000	8,973	989,612		2023/07/15
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	11,250	10,768	1,187,583		2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	8,980	8,807	971,320		2025/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	2,390	2,696	297,328		2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	3,000	3,877	427,584		2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	1,600	2,069	228,238		2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	2,580	3,376	372,324		2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	4,500	5,045	556,392		2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	7,650	9,128	1,006,702		2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	2,510	3,523	388,561		2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	5,050	6,465	713,045		2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	7,480	8,595	947,951		2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	14,040	14,765	1,628,287		2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	7,630	8,617	950,330		2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	12,260	12,603	1,389,953		2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	10,000	10,475	1,155,226		2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	15,210	16,108	1,776,427		2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	6,730	6,913	762,391		2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	11,340	13,450	1,483,348		2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	11,540	12,335	1,360,323		2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	11,430	11,753	1,296,198		2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	12,860	14,287	1,575,643		2028/08/15
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	2,920	2,971	327,665		2022/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	6,430	6,964	768,099		2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	7,880	8,067	889,645		2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	11,760	12,008	1,324,299		2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	8,000	8,164	900,367		2022/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	7,030	7,334	808,822		2024/08/31

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 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	7,030	7,407	816,908		2023/08/31
US T N/B 1.625 08/31/22	国債証券	1.6250	3,930	3,998	440,967		2022/08/31
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	4,680	4,754	524,335		2022/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	11,040	9,435	1,040,526		2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	14,630	12,232	1,348,950		2050/08/15
US T N/B 0.125 08/31/22	国債証券	0.1250	6,920	6,920	763,227		2022/08/31
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	29,840	27,730	3,058,088		2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	4,750	4,855	535,493		2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	8,400	8,597	948,171		2024/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	9,920	9,715	1,071,371		2025/08/31
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	8,310	8,282	913,383		2023/08/15
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	10,590	10,197	1,124,526		2027/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	6,360	6,963	767,902		2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	6,400	6,732	742,487		2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	9,820	10,058	1,109,304		2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	3,650	3,725	410,839		2022/09/30
US T N/B 1.875 09/30/22	国債証券	1.8750	3,270	3,342	368,630		2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	7,810	8,265	911,550		2023/09/30
US T N/B 1.5 09/15/22	国債証券	1.5000	8,410	8,551	943,069		2022/09/15
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	12,630	12,580	1,387,395		2023/09/15
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	13,470	12,846	1,416,710		2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	3,820	3,952	435,898		2026/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	13,480	13,190	1,454,694		2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	6,490	6,695	738,362		2024/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	6,560	6,929	764,186		2024/10/31
US T N/B 1.875 10/31/22	国債証券	1.8750	4,000	4,094	451,510		2022/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	5,620	6,155	678,845		2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	9,650	9,944	1,096,668		2023/10/31
US T N/B 2.0 10/31/22	国債証券	2.0000	2,720	2,788	307,484		2022/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	9,430	9,993	1,102,093		2023/10/31
US T N/B 1.375 10/15/22	国債証券	1.3750	5,500	5,588	616,348		2022/10/15
US T N/B 0.125 10/31/22	国債証券	0.1250	7,910	7,906	871,974		2022/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	5,100	5,277	582,025		2026/10/31
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	13,940	13,877	1,530,397		2023/10/15
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	8,000	8,255	910,361		2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	10,000	9,603	1,059,075		2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	13,510	13,200	1,455,720		2025/10/31
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,700	2,179	240,364		2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,050	2,685	296,103		2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	7,070	8,271	912,164		2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	3,320	4,555	502,369		2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	4,920	5,515	608,195		2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	3,780	4,481	494,205		2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	6,300	8,224	907,046		2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	9,540	10,784	1,189,292		2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	17,120	15,252	1,682,084		2050/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	3,370	3,959	436,681		2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	7,030	8,105	893,829		2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	14,440	15,259	1,682,764		2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	2,700	3,738	412,275		2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	10,850	13,765	1,518,107		2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	11,710	12,372	1,364,422		2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	15,100	16,053	1,770,410		2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	15,380	17,376	1,916,268		2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	8,330	8,504	937,902		2022/11/15

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	
				千円	千円		
<b>(アメリカ)</b>		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	19,530	20,657	2,278,114	2023/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	10,830	11,417	1,259,134	2026/11/15	
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	12,020	12,334	1,360,206	2022/11/30	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	12,650	13,522	1,491,223	2027/11/15	
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	8,000	8,346	920,493	2023/11/30	
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	6,670	7,021	774,299	2024/11/30	
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	6,140	6,697	738,641	2025/11/30	
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	8,670	9,203	1,014,951	2023/11/30	
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	20,540	18,340	2,022,620	2040/11/15	
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	5,310	5,492	605,739	2026/11/30	
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	6,900	7,111	784,265	2029/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	32,530	30,860	3,403,273	2030/11/15	
US T N/B 0.25 11/15/23	国債証券	0.2500	12,280	12,256	1,351,699	2023/11/15	
US T N/B 0.125 11/30/22	国債証券	0.1250	8,450	8,443	931,137	2022/11/30	
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	14,510	14,028	1,547,032	2027/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	9,140	9,431	1,040,127	2024/11/30	
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	15,540	15,251	1,681,953	2025/11/30	
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	8,000	8,373	923,422	2023/12/31	
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	7,320	7,736	853,161	2023/12/31	
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	6,300	6,809	750,942	2025/12/31	
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	7,210	7,626	841,024	2024/12/31	
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	10,620	10,928	1,205,165	2022/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	4,990	5,194	572,867	2026/12/31	
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	10,000	9,944	1,096,725	2023/12/15	
US T N/B 1.625 12/15/22	国債証券	1.6250	8,600	8,785	968,858	2022/12/15	
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	8,300	8,638	952,616	2024/12/31	
US T N/B 0.125 12/31/22	国債証券	0.1250	10,000	9,990	1,101,766	2022/12/31	
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	11,070	10,850	1,196,574	2025/12/31	
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	14,160	13,672	1,507,855	2027/12/31	
小計	—	—	2,200,010	2,281,074	251,556,942	—	
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 0.25 02/01/23	国債証券	0.2500	5,650	5,637	502,044	2023/02/01	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	3,660	3,822	340,410	2024/03/01	
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	4,490	4,591	408,896	2023/03/01	
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	2,200	2,238	199,375	2025/03/01	
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	5,260	5,085	452,865	2026/03/01	
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	8,430	8,343	742,950	2024/04/01	
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	9,340	9,306	828,766	2023/05/01	
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,400	1,434	127,775	2026/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,440	1,926	171,516	2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	2,240	3,255	289,883	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	1,480	2,172	193,416	2037/06/01	
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	2,620	2,763	246,087	2024/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	1,960	2,701	240,528	2041/06/01	
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	2,950	3,019	268,897	2022/06/01	
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	3,110	3,173	282,612	2023/06/01	
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	2,370	2,500	222,642	2028/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	2,800	2,959	263,565	2025/06/01	
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	2,850	2,835	252,533	2027/06/01	
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	1,910	2,053	182,842	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	7,990	7,911	704,526	2030/06/01	
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,200	2,204	196,345	2031/06/01	
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	2,150	2,206	196,448	2024/09/01	
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	6,220	6,423	571,999	2023/09/01	
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	3,000	3,024	269,343	2022/09/01	

銘柄	当		期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	6,690	6,587	586,629	2025/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	3,410	3,400	302,855	2026/09/01
CANADA 0.25 11/01/22	国債証券	0.2500	2,450	2,446	217,877	2022/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	2,570	3,419	304,549	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	3,080	3,679	327,677	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	6,910	7,127	634,661	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	2,190	2,727	242,851	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	8,960	8,233	733,180	2030/12/01
小計	—	—	123,980	129,214	11,506,558	—
<b>(オーストラリア)</b>		%	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	2,970	3,402	282,220	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	5,320	5,856	485,767	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	6,290	7,657	635,219	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	3,190	3,428	284,385	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	5,440	6,339	525,884	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	8,510	9,352	775,800	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	6,200	7,139	592,258	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	2,890	3,800	315,265	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	2,970	3,721	308,701	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	4,220	4,530	375,830	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	8,040	8,810	730,863	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	3,040	3,346	277,608	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	5,110	4,953	410,899	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	2,150	2,543	210,985	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	6,120	6,135	508,909	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	1,740	1,947	161,564	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	4,130	3,586	297,533	2051/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	2,540	2,694	223,533	2022/07/15
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	5,270	5,173	429,114	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	3,750	4,172	346,111	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	4,420	4,883	405,062	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	5,760	6,405	531,352	2029/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	4,270	4,404	365,315	2022/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	2,410	2,449	203,185	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	7,880	7,486	621,019	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	4,430	4,341	360,133	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	6,940	6,890	571,583	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	8,710	8,371	694,421	2030/12/21
小計	—	—	134,710	143,827	11,930,532	—
<b>(シンガポール)</b>		%	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	930	965	79,163	2024/02/01
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	1,810	1,849	151,633	2023/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	2,090	2,375	194,783	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	2,080	2,458	201,577	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	1,340	1,370	112,328	2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	1,280	1,480	121,423	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	1,250	1,370	112,326	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	1,230	1,311	107,503	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	1,450	1,539	126,236	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	1,530	1,707	139,996	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	780	848	69,539	2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	1,780	1,862	152,728	2023/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	1,500	1,590	130,402	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	1,790	1,926	157,916	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	820	847	69,450	2022/09/01

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		
(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 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	2,200	2,468	202,423		2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	1,540	1,824	149,623		2033/09/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	730	722	59,224		2025/11/01
小計	—	—	26,130	28,519	2,338,281		—
(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	4,970	6,970	1,069,351		2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	4,750	6,975	1,070,068		2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	2,990	5,664	868,864		2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	3,090	3,472	532,617		2049/01/22
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	2,240	2,063	316,556		2046/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	9,620	9,595	1,471,877		2024/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	4,870	4,728	725,428		2028/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	7,480	7,481	1,147,638		2023/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	5,610	5,542	850,161		2026/01/30
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	3,650	4,287	657,635		2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	4,190	6,015	922,753		2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	2,860	2,924	448,557		2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	4,910	6,632	1,017,475		2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	3,610	3,658	561,242		2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	5,480	5,813	891,826		2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	3,690	6,124	939,498		2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	5,170	6,064	930,240		2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	3,480	5,160	791,668		2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	4,690	8,841	1,356,258		2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	3,170	3,344	513,085		2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	3,760	3,930	602,946		2027/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	5,230	5,254	806,061		2022/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	4,000	4,052	621,607		2023/07/22
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	2,750	2,582	396,086		2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	6,520	6,122	939,207		2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	2,720	4,105	629,854		2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	4,920	5,149	789,884		2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	2,560	2,765	424,215		2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	2,750	2,945	451,763		2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	3,160	4,531	695,176		2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	5,560	6,069	931,040		2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	5,000	5,100	782,394		2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	3,460	3,860	592,215		2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	2,960	2,365	362,824		2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	1,420	1,742	267,288		2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	4,320	4,344	666,445		2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	3,970	3,385	519,365		2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	4,480	4,812	738,168		2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	3,840	3,890	596,819		2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	4,180	4,018	616,499		2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	810	805	123,601		2026/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	1,450	2,017	309,444		2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	3,560	5,613	861,045		2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	4,510	7,328	1,124,201		2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	3,860	6,414	984,047		2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	3,520	6,589	1,010,787		2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	3,280	4,057	622,427		2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	3,190	4,899	751,619		2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	4,100	5,588	857,207		2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	3,110	5,385	826,162		2049/12/07
小計	—	—	199,470	241,090	36,983,218		—



銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨換算金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(イスラエル)</b>		%	千イスラエル・シユケル	千イスラエル・シユケル	千円		
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	4,900	7,730	261,043	2042/01/31	
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	6,420	8,133	274,651	2047/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	4,340	4,666	157,565	2027/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	5,070	5,558	187,705	2024/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	4,560	4,493	151,728	2030/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	5,570	5,973	201,730	2023/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	4,270	4,285	144,700	2025/04/30	
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	3,710	3,494	117,999	2037/05/31	
ISRAEL FIXED BOND 0.15 07/31/23	国債証券	0.1500	6,060	6,052	204,370	2023/07/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	4,500	4,746	160,264	2025/08/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	4,620	5,049	170,513	2028/09/28	
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	4,450	5,779	195,150	2026/10/30	
ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	国債証券	1.5000	4,730	4,877	164,717	2023/11/30	
ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	国債証券	1.2500	3,230	3,282	110,837	2022/11/30	
小計	-	-	66,430	74,122	2,502,978	-	
<b>(デンマーク)</b>		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円		
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	10,300	9,249	163,344	2052/11/15	
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	28,760	50,439	890,755	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	16,950	18,576	328,052	2025/11/15	
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	15,600	16,367	289,044	2023/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	17,770	18,603	328,542	2027/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	25,320	26,529	468,518	2029/11/15	
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	6,420	6,350	112,153	2031/11/15	
DENMARK 0.25 11/15/22	国債証券	0.2500	4,700	4,745	83,798	2022/11/15	
小計	-	-	125,820	150,861	2,664,210	-	
<b>(ノルウェー)</b>		%	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	10,870	11,052	141,912	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	9,840	10,105	129,756	2027/02/17	
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	12,640	13,367	171,637	2024/03/14	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	10,570	10,849	139,305	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	9,620	10,049	129,036	2028/04/26	
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	19,260	19,770	253,848	2023/05/24	
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	11,960	11,892	152,700	2030/08/19	
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	10,710	10,994	141,170	2029/09/06	
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	9,100	8,901	114,296	2031/09/17	
小計	-	-	104,570	106,983	1,373,665	-	
<b>(スウェーデン)</b>		%	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	11,420	16,721	215,880	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	13,480	14,048	181,363	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	24,440	26,993	348,485	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	11,990	11,703	151,093	2031/05/12	
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	13,110	13,582	175,354	2022/06/01	
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	6,600	7,893	101,899	2032/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	21,900	22,824	294,670	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	18,290	19,283	248,945	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	14,910	15,534	200,548	2029/11/12	
小計	-	-	136,140	148,585	1,918,241	-	
<b>(メキシコ)</b>		%	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	74,714	73,068	392,572	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	66,830	68,555	368,327	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	67,501	74,970	402,792	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	52,700	56,121	301,523	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	69,445	72,913	391,741	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	24,139	24,501	131,636	2022/06/09	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	57,570	60,971	327,581	2024/09/05	

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
				外貨建金額	邦貨換算金額			
<b>(メキシコ)</b>		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円			
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	41,418	42,878	230,373		2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	58,126	61,681	331,396		2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	48,613	54,045	290,372		2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	18,223	23,038	123,780		2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	19,311	20,581	110,576		2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	58,893	66,314	356,288		2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	98,133	103,659	556,933		2023/12/07	
小計	-	-	755,616	803,301	4,315,898		-	
<b>(マレーシア)</b>		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円			
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	1,370	1,445	38,482		2027/03/15	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	2,000	2,109	56,153		2046/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	5,610	5,758	153,272		2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,030	3,267	86,970		2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	3,050	3,322	88,425		2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	2,390	2,419	64,381		2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	3,730	4,078	108,546		2037/04/07	
MALAYSIA 3.757 04/20/23	国債証券	3.7570	3,160	3,263	86,850		2023/04/20	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	2,490	2,357	62,743		2031/04/15	
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	3,950	3,730	99,285		2040/05/22	
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	2,200	2,292	61,020		2035/05/31	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	3,590	3,758	100,019		2028/06/15	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	3,000	3,189	84,891		2031/06/30	
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	1,430	1,583	42,141		2038/06/08	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	3,330	3,445	91,693		2024/06/14	
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	4,320	4,187	111,449		2050/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,480	2,620	69,753		2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	3,400	3,679	97,918		2048/07/06	
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	2,130	2,250	59,902		2026/07/15	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	5,150	5,164	137,456		2034/07/05	
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	5,910	6,206	165,191		2029/08/15	
MALAYSIA 3.8 08/17/23	国債証券	3.8000	3,070	3,185	84,768		2023/08/17	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	7,840	8,288	220,599		2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,970	2,158	57,450		2043/09/30	
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	2,600	2,743	73,014		2024/09/30	
MALAYSIA 3.795 09/30/22	国債証券	3.7950	2,600	2,663	70,875		2022/09/30	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	4,140	4,372	116,384		2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	4,240	4,480	119,247		2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	2,400	2,600	69,208		2033/11/07	
小計	-	-	96,580	100,624	2,678,100		-	
<b>(ポーランド)</b>		%	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	7,660	7,932	229,940		2023/01/25	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	120	156	4,550		2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	9,310	10,087	292,417		2028/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	10,950	11,529	334,211		2024/04/25	
POLAND 04/25/23	国債証券	0.0000	3,410	3,387	98,187		2023/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	7,980	7,941	230,206		2025/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	10,300	10,921	316,586		2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	9,190	10,006	290,069		2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	8,290	8,807	255,309		2027/07/25	
POLAND 07/25/22	国債証券	-	4,910	4,909	142,304		2022/07/25	
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	4,000	4,282	124,142		2022/09/23	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	7,940	8,601	249,347		2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	4,360	4,742	137,467		2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	6,870	7,207	208,928		2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	16,800	16,080	466,145		2030/10/25	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド) POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	% 0.2500	千ポーランド・ズロチ 2,700	千ポーランド・ズロチ 2,544	千円 73,752	2026/10/25
小計	-	-	114,790	119,136	3,453,567	-
(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	2,060	2,631	345,483	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	1,420	1,592	209,031	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	2,290	2,537	333,224	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	2,730	3,329	437,157	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	2,320	2,501	328,461	2023/03/20
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	990	968	127,203	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	1,480	1,714	225,121	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	1,740	1,949	256,001	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	2,610	3,159	414,805	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	2,160	2,316	304,121	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	2,280	2,483	326,132	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	2,740	2,922	383,752	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	1,600	1,896	248,992	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	1,330	1,329	174,612	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	1,720	1,765	231,762	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	730	715	93,962	2031/10/18
IRISH 10/18/22	国債証券	0.0000	160	161	21,173	2022/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	1,660	1,675	219,950	2030/10/18
小計	-	-	32,020	35,650	4,680,950	-
(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	666	87,483	2023/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	3,900	6,668	875,519	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	3,920	6,299	827,119	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	2,130	1,894	248,775	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	2,670	3,715	487,854	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	4,220	6,737	884,653	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	3,620	4,676	614,082	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	2,970	3,116	409,193	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	9,280	9,441	1,239,707	2024/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	4,060	4,155	545,589	2027/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	5,010	5,264	691,174	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	6,450	6,775	889,568	2026/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	3,650	3,948	518,396	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	3,530	3,648	479,027	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	3,660	3,937	517,005	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	4,170	4,463	586,062	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	2,920	3,032	398,136	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	3,340	3,382	444,158	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,280	1,287	169,055	2031/07/15
小計	-	-	71,370	83,111	10,912,566	-
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	4,660	6,513	855,264	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	4,270	7,144	938,032	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	2,590	3,209	421,362	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	1,950	2,764	362,980	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	4,010	6,548	859,766	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	2,400	2,695	353,910	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	2,230	3,692	484,835	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	2,770	3,260	428,145	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	4,450	5,360	703,869	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	370	513	67,474	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	1,340	1,887	247,796	2066/06/22

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…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	1,420	1,175	154,341	2071/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	4,340	4,649	610,450	2026/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	4,100	4,497	590,477	2024/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	3,110	3,403	446,825	2031/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	5,250	5,557	729,678	2023/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	4,570	4,906	644,204	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	1,060	1,014	133,175	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	4,270	4,613	605,810	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	2,140	2,880	378,190	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	2,380	2,913	382,494	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	4,720	4,970	652,567	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	3,060	3,265	428,709	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	60	68	9,050	2037/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	3,100	3,129	410,937	2030/06/22	
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	1,380	1,466	192,575	2022/09/28	
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	2,820	2,922	383,787	2024/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	2,190	2,160	283,615	2031/10/22	
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	2,610	2,661	349,495	2023/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	1,990	2,025	265,917	2027/10/22	
小計	-	-	85,610	101,871	13,375,741	-	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	国債証券	0.0000	4,660	4,709	618,306	2023/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	2,000	2,031	266,793	2027/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	11,570	11,785	1,547,480	2026/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	5,490	5,575	732,066	2024/02/25	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	9,810	9,970	1,309,146	2024/03/25	
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	11,000	11,205	1,471,315	2025/03/25	
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	10,860	10,980	1,441,707	2023/03/25	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,480	1,730	227,228	2023/04/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	10,550	12,568	1,650,206	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	10,430	18,045	2,369,333	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	3,510	6,615	868,588	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	3,520	6,928	909,668	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	8,210	11,854	1,556,479	2029/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	6,130	9,813	1,288,574	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	6,450	10,018	1,315,483	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	6,760	8,666	1,137,905	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	9,140	10,577	1,388,766	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	6,860	6,516	855,665	2052/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	4,810	6,013	789,602	2066/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	2,000	1,532	201,216	2072/05/25	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	7,080	7,673	1,007,501	2024/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	11,550	14,135	1,855,927	2030/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	11,660	12,423	1,631,205	2028/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	12,910	14,703	1,930,536	2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	11,200	11,639	1,528,291	2025/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	12,050	12,605	1,655,142	2029/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	10,120	11,301	1,483,873	2034/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	9,150	9,556	1,254,706	2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	8,200	8,832	1,159,696	2027/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	3,370	3,292	432,325	2040/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	15,040	15,730	2,065,393	2023/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	10,080	11,253	1,477,559	2036/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	6,940	8,386	1,101,148	2039/06/25	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,360	1,294	170,004	2044/06/25	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額	千円	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	11,620	12,954	1,700,986	2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,220	2,852	374,527	2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	12,790	15,264	2,004,293	2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	6,160	9,758	1,281,304	2038/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	8,090	13,183	1,730,986	2032/10/25	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	9,150	9,509	1,248,588	2022/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	9,090	9,809	1,288,044	2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	9,000	9,580	1,257,874	2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	10,210	10,538	1,383,735	2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	9,680	10,326	1,355,885	2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	2,400	2,359	309,819	2031/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	11,680	11,607	1,524,083	2030/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	9,260	9,281	1,218,636	2029/11/25	
小計	-	-	377,300	436,996	57,377,617	-	
(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	1,389	182,485	2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	890	1,254	164,651	2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	1,400	2,208	289,961	2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	5,340	8,354	1,096,992	2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	7,380	11,999	1,575,539	2037/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	7,100	7,403	972,101	2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	8,490	8,927	1,172,201	2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	6,540	6,862	901,052	2029/02/15	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	5,050	5,232	687,073	2023/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	8,050	8,569	1,125,160	2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	9,570	10,194	1,338,525	2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	7,650	7,988	1,048,901	2027/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	4,670	4,770	626,366	2031/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	7,490	7,691	1,009,940	2030/02/15	
BUNDESSCHAT 0.0 03/10/23	国債証券	0.0000	5,570	5,632	739,601	2023/03/10	
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	5,060	5,122	672,602	2023/04/14	
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	6,080	6,194	813,330	2024/04/05	
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	4,910	5,029	660,365	2025/04/11	
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	4,100	4,212	553,128	2026/04/10	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	5,390	5,734	752,962	2024/05/15	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	7,790	8,115	1,065,543	2023/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	5,640	5,631	739,428	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	2,480	2,453	322,185	2036/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,670	2,392	314,134	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	2,380	3,272	429,666	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	4,590	8,072	1,059,916	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	4,020	6,648	872,934	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	7,690	11,778	1,546,451	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	4,980	9,412	1,235,880	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	5,280	5,412	710,677	2022/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	5,840	9,597	1,260,168	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	6,680	10,446	1,371,623	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	8,930	11,257	1,478,084	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/45	国債証券	1.0000	6,350	6,783	890,683	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	8,390	8,909	1,169,810	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	9,270	9,537	1,252,275	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	6,430	6,740	885,070	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	6,230	6,593	865,791	2023/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	4,400	4,635	608,584	2024/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	7,680	7,896	1,036,761	2029/08/15	

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…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	5,510	5,058	664,184	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	9,110	9,335	1,225,711	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,320	2,388	313,602	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	4,600	4,721	619,945	2022/09/04	
BUNDESSCHAT 0.0 09/16/22	国債証券	0.0000	2,230	2,248	295,240	2022/09/16	
BUNDESOWL 10/18/24	国債証券	0.0000	5,540	5,661	743,412	2024/10/18	
BUNDESOWL 10/07/22	国債証券	0.0000	3,790	3,823	502,046	2022/10/07	
BUNDESOWL 10/13/23	国債証券	0.0000	3,940	4,003	525,723	2023/10/13	
BUNDESOWL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	6,960	7,143	937,927	2025/10/10	
BUNDESOWL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,000	1,027	134,917	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	6,660	6,854	899,983	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,000	2,056	269,978	2028/11/15	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/22	国債証券	0.0000	3,000	3,029	397,792	2022/12/15	
小計	-	-	285,290	327,715	43,029,089	-	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	820	1,184	155,582	2029/01/31	
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	3,840	4,371	574,006	2024/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	5,260	7,833	1,028,589	2037/01/31	
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	5,480	6,004	788,429	2023/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	5,920	5,998	787,556	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,400	1,396	183,296	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	2,200	2,222	291,877	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	5,130	5,521	724,930	2025/04/30	
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	5,470	6,137	805,796	2024/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	4,340	4,747	623,293	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	5,170	5,718	750,902	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	5,310	5,797	761,265	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	6,430	7,064	927,633	2029/04/30	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	5,040	5,124	672,783	2030/04/30	
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	4,890	4,723	620,207	2031/04/30	
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	9,700	9,776	1,283,646	2023/04/30	
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	3,200	3,238	425,182	2024/05/31	
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	5,590	7,341	963,882	2026/07/30	
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	4,720	7,865	1,032,790	2040/07/30	
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	4,850	8,002	1,050,744	2041/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	3,750	5,772	757,908	2066/07/30	
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	5,310	6,406	841,148	2025/07/30	
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	5,660	6,482	851,199	2030/07/30	
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	5,510	8,621	1,131,983	2032/07/30	
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	4,660	5,573	731,782	2033/07/30	
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	6,200	6,771	889,116	2028/07/30	
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	4,900	5,582	733,033	2035/07/30	
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	4,190	4,277	561,607	2024/07/30	
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	5,050	5,141	675,110	2023/07/30	
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	390	382	50,264	2037/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	5,720	6,016	789,939	2027/07/30	
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	5,470	6,056	795,200	2024/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	5,630	7,714	1,012,951	2028/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	3,530	6,369	836,365	2044/10/31	
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	4,920	6,639	871,747	2046/10/31	
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	3,730	4,889	641,932	2048/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	1,460	1,286	168,978	2071/10/31	
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	4,820	4,350	571,279	2050/10/31	
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	5,460	6,047	794,001	2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	5,390	5,891	773,568	2027/10/31	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	6,490	7,005	919,873	2026/10/31	
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	7,030	7,235	949,973	2029/10/31	
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	4,600	5,136	674,393	2023/10/31	
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	4,320	4,379	575,007	2022/10/31	
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	4,110	4,158	546,062	2040/10/31	
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	6,970	7,542	990,295	2030/10/31	
小計	—	—	220,030	255,804	33,587,121	—	
(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	4,800	4,953	650,407	2027/01/15	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	4,750	4,777	627,292	2024/01/15	
ITALY BTPS 0.05 01/15/23	国債証券	0.0500	4,100	4,128	542,028	2023/01/15	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	3,690	5,603	735,757	2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	5,720	7,859	1,031,923	2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	5,660	6,240	819,429	2028/02/01	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	5,200	5,275	692,632	2025/02/01	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	4,100	4,173	547,939	2026/02/01	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	4,830	5,769	757,526	2047/03/01	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	4,000	5,424	712,239	2048/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	5,190	5,846	767,612	2024/03/01	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	2,400	2,840	372,944	2067/03/01	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	1,380	1,346	176,754	2072/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	3,820	4,532	595,059	2025/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	6,500	7,835	1,028,748	2026/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	6,410	6,882	903,686	2032/03/01	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	4,440	5,598	735,066	2040/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	4,170	5,304	696,441	2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	6,860	8,486	1,114,282	2030/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	4,210	4,304	565,133	2023/03/15	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	4,070	4,159	546,202	2023/03/01	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	8,000	8,212	1,078,235	2036/03/01	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	3,700	3,844	504,756	2041/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	3,450	3,268	429,203	2037/03/01	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	5,610	5,536	726,943	2028/03/15	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	2,130	2,056	269,964	2045/04/30	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	5,930	6,255	821,383	2030/04/01	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	5,770	5,812	763,185	2031/04/01	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国債証券	0.0000	3,350	3,365	441,922	2024/04/15	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	2,430	2,413	316,921	2026/04/01	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	4,300	6,415	842,368	2031/05/01	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	5,480	5,974	784,504	2023/05/01	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	3,100	3,282	431,044	2024/05/15	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	3,120	3,296	432,876	2025/05/15	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	5,790	6,197	813,670	2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	4,010	4,248	557,766	2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	3,450	3,831	503,039	2027/06/01	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	国債証券	0.6000	4,500	4,584	601,963	2023/06/15	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	4,540	4,979	653,835	2026/07/15	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	4,630	4,894	642,636	2024/07/01	
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	国債証券	1.0000	3,050	3,096	406,521	2022/07/15	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	4,670	5,010	657,932	2025/07/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	3,950	5,802	761,822	2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	4,220	6,616	868,806	2039/08/01	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	5,830	6,453	847,308	2023/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	5,980	6,593	865,774	2027/08/01	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	4,790	5,692	747,480	2029/08/01	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	2,500	2,536	333,058	2022/08/01	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	2,880	2,806	368,471	2031/08/01	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	4,750	4,835	634,901	2030/08/01	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	3,710	3,757	493,358	2023/08/15	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	5,030	6,208	815,113	2038/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	5,560	8,861	1,163,557	2044/09/01	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	3,980	5,203	683,239	2046/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	5,660	7,352	965,415	2028/09/01	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	3,020	4,770	626,392	2040/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	3,480	3,966	520,756	2050/09/01	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	2,000	1,930	253,490	2051/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	8,170	9,456	1,241,575	2033/09/01	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	5,300	5,956	782,099	2024/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	2,660	3,862	507,096	2049/09/01	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	2,960	3,167	415,915	2022/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	4,130	4,686	615,366	2036/09/01	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	4,140	4,233	555,845	2022/09/15	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	5,100	5,283	693,669	2027/09/15	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	3,340	3,411	447,970	2023/10/15	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	10,900	11,578	1,520,267	2023/10/01	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,700	2,071	271,981	2023/11/01	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	2,150	2,956	388,127	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	3,400	4,703	617,532	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	6,940	9,543	1,253,112	2029/11/01	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	5,560	6,003	788,247	2022/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	4,690	4,936	648,098	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	3,550	3,929	515,963	2025/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	5,610	6,089	799,487	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	6,030	6,360	835,193	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	5,790	6,303	827,640	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	5,660	6,594	865,871	2028/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	5,570	6,004	788,343	2030/12/01	
小計	—	—	358,000	408,439	53,628,139	—	
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券	0.1250	940	819	107,636	2052/04/15	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	1,220	1,311	172,161	2024/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	980	1,054	138,390	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	980	1,192	156,615	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	2,170	2,271	298,292	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	1,250	1,399	183,696	2034/04/15	
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	1,400	1,454	190,996	2023/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	770	750	98,517	2036/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	1,500	1,779	233,604	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	1,470	1,786	234,593	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	1,080	1,564	205,357	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	1,560	1,642	215,721	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	1,360	1,441	189,214	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	990	1,043	137,031	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	1,620	1,704	223,794	2027/09/15	
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	150	154	20,246	2022/09/15	
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	2,050	2,079	272,996	2023/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	1,030	997	131,031	2040/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	1,280	1,284	168,659	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	960	978	128,444	2024/09/15	
小計	—	—	24,760	26,709	3,507,000	—	



銘柄	当期				期末	
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(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	980	2,030	266,592	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	2,420	2,956	388,241	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	2,740	2,881	378,317	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	3,340	3,569	468,637	2028/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	1,960	1,954	256,594	2031/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	2,420	2,433	319,456	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	2,490	3,125	410,319	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	3,260	5,189	681,436	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	1,230	1,263	165,907	2051/03/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	2,630	2,763	362,830	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/23	国債証券	0.0000	2,800	2,831	371,814	2023/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	1,700	1,733	227,600	2025/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	1,960	2,512	329,952	2034/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	890	811	106,613	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	1,700	2,698	354,297	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	360	505	66,361	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	2,330	2,358	309,691	2023/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	2,700	2,746	360,656	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	1,290	2,116	277,924	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	2,520	2,708	355,685	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	3,830	4,068	534,130	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	5,040	5,415	711,049	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	3,720	3,925	515,479	2023/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	670	609	80,088	2040/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	500	646	84,924	2086/11/02
小計	—	—	55,480	63,858	8,384,606	—
合計	—	—	—	—	561,705,029	—

## ■投資信託財産の構成

2021年6月22日現在

項目	当期		末
	評価額	比率	率
公社債	千円		%
コール・ローン等、その他	561,705,029		97.5
投資信託財産総額	14,623,069		2.5
	576,328,099		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、568,693,101千円、98.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.28円、1カナダ・ドル=89.05円、1オーストラリア・ドル=82.95円、1シンガポール・ドル=81.99円、1イギリス・ポンド=153.40円、1イスラエル・シェケル=33.768円、1デンマーク・クローネ=17.66円、1ノルウェー・クローネ=12.84円、1スウェーデン・クローナ=12.91円、1メキシコ・ペソ=5.372円、1マレーシア・リンギット=26.614円、1ポーランド・ズロチ=28.988円、1ユーロ=131.30円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,140,589,337,359円
コ ー ル ・ ロ ー ド 等	5,982,134,647
公 社 債(評価額)	561,705,029,522
未 収 入 金	569,916,164,537
未 収 利 息	2,003,307,375
前 払 費 用	982,701,278
(B) 負 債	566,615,189,847
未 払 金	566,323,774,847
未 払 解 約 金	291,415,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	573,974,147,512
元 本	400,458,673,144
次 期 繰 越 損 益 金	173,515,474,368
(D) 受 益 権 総 口 数	400,458,673,144口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	14,333円

(注1) 期首元本額	230,136,350,831円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	5,277,272,203円
追加設定元本額	565,675,279,033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)	619,835,953円
一部解約元本額	395,352,956,720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)	51,516,049円
(注2) 期末における元本の内訳		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)	390,453,672円
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	6,788,674,964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)	775,672,614円
たわらノーロード バランス (堅実型)	528,563,003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)	1,069,300,883円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,306,760,517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)	2,117,710,070円
たわらノーロード バランス (積極型)	601,658,116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)	2,222,164,083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)	33,167,612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)	2,940,401,092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)	956,952,163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)	118,069,032円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	1,094,138,891円	期末元本合計	400,458,673,144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)	373,876,086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)	193,021,332円		
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	6,563,892円		
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	8,588,779円		
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	39,583,884円		
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	7,433,473円		
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	8,941,807円		
投資のソムリエ	212,878,283,847円		
投資のソムリエ<DC年金>	11,145,267,997円		
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,623,250,466円		
リスク抑制世界8資産バランスファンド	68,534,931,432円		
ワールドアセットバランス (基本コース)	2,973,015,177円		
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	9,383,512,628円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	148,535,733円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	71,515,133円		
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	63,837,100円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	482,714,372円		
リスクコントロール世界資産分散ファンド	29,613,002,313円		
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,310,479,003円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	111,230,426円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	53,757,770円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	50,943,220円		
外国債券パッシブファンド2 (為替フルヘッジ)	19,937,006,424円		
先進国債券パッシブファンド (為替ヘッジあり)	6,547,069,933円		

## ■損益の状況

当期 自2020年6月23日 至2021年6月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	8,654,809,203	円
	受取利息	8,655,895,204	
	その他の収益	749,230	
	支払利息	△1,835,231	
(B)	有価証券売買損益	△21,700,070,063	
	売買取益	66,281,476,334	
	売買取損	△87,981,546,397	
(C)	その他の費用	△55,445,069	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△13,100,705,929	
(E)	前期繰越損益金	107,196,961,518	
(F)	解約差損益金	△177,175,094,188	
(G)	追加信託差損益金	256,594,312,967	
(H)	計(D+E+F+G)	173,515,474,368	
	次期繰越損益金(H)	173,515,474,368	

(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。

## 《お知らせ》

■信託金の限度額を1兆円から5兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年1月8日)