

運用報告書 (全体版)

第6期<決算日2022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・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
運用方法	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
	海外の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	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。
分配方針	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。
	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、2022年10月12日に第6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>

■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 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配 金	期中 騰落 率	期中 騰落 率	期中 騰落 率			
2期 (2018年10月12日)	円 9,380	円 0	% △2.5	ポイント 375.63	% △2.1	% 98.3	% -	百万円 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
6期 (2022年10月12日)	8,510	0	△16.5	346.27	△16.3	98.9	-	10,307

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジあり) です (以下同じ)。

(注4) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します (以下同じ)。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 比
	円	騰 落 率	ポイ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 10 月 12 日	10,194	% —	ポイ ン ト 413.63	% —	% 100.3	% —
10 月 末	10,256	0.6	416.21	0.6	100.5	—
11 月 末	10,317	1.2	418.85	1.3	96.7	—
12 月 末	10,222	0.3	415.09	0.4	100.4	—
2022 年 1 月 末	10,090	△1.0	409.98	△0.9	97.7	—
2 月 末	9,879	△3.1	401.33	△3.0	98.1	—
3 月 末	9,613	△5.7	390.67	△5.6	102.4	—
4 月 末	9,397	△7.8	382.14	△7.6	134.0	—
5 月 末	9,304	△8.7	378.13	△8.6	98.7	—
6 月 末	9,046	△11.3	367.91	△11.1	103.9	—
7 月 末	9,310	△8.7	378.91	△8.4	97.0	—
8 月 末	8,989	△11.8	365.57	△11.6	101.6	—
9 月 末	8,605	△15.6	350.26	△15.3	102.0	—
(期 末) 2022 年 10 月 12 日	8,510	△16.5	346.27	△16.3	98.9	—

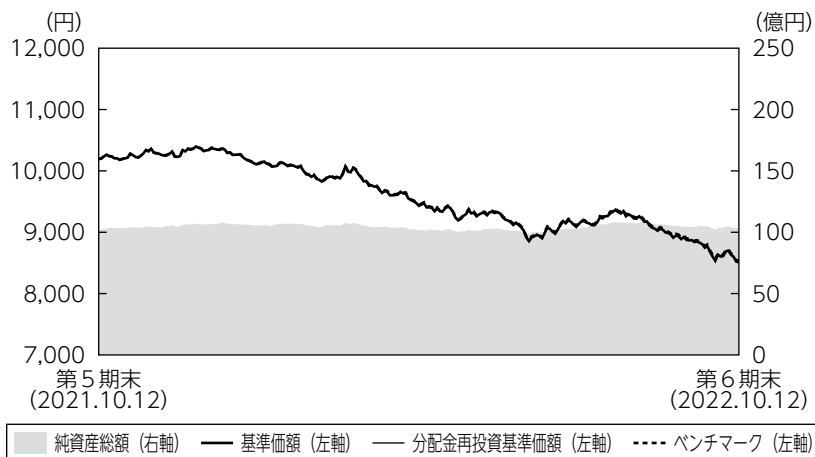
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2021年10月13日から2022年10月12日まで）

基準価額等の推移



第6期首：10,194円
第6期末：8,510円
(既払分配金0円)
騰落率：△16.5%
(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

堅調な米雇用統計や、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを積極的に続けるとの見方、米インフレ率の上振れなどを背景に米国債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドイツ国債についてもロシアのウクライナへの侵攻や米国長期金利の上昇、E C B（欧州中央銀行）が大幅利上げを行ったことなどを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。米国債は、堅調な米雇用統計や、F R B が金融引き締めを積極的に続けるとの見方、米インフレ率の上振れ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ロシアのウクライナ侵攻によるエネルギー価格の高騰や米長期金利の上昇、E C B が大幅利上げを行ったこと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

●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。

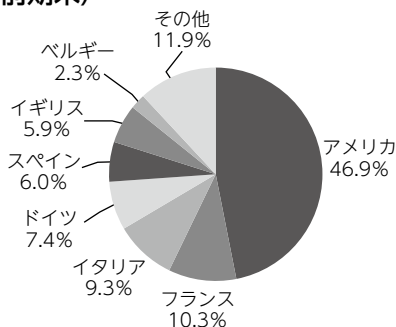
●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

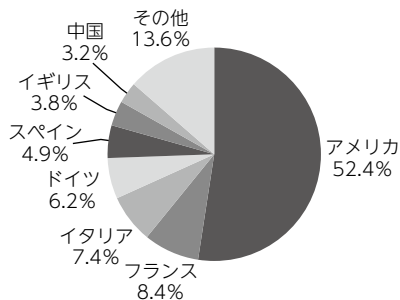
【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○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。

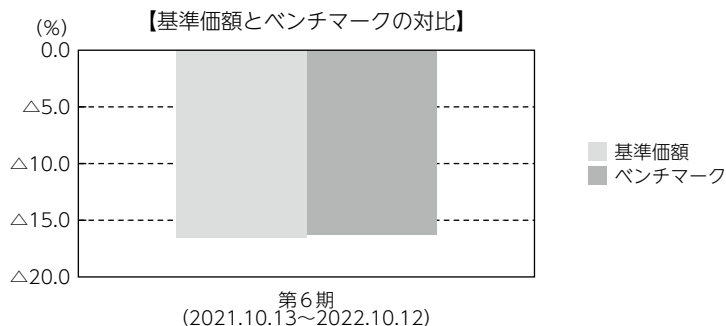
(注3) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

(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16.3%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.2%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
	2021年10月13日 ～2022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	1,193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6期		項目の概要
	(2021年10月13日 ～2022年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	21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9,585円です。
(投信会社)	(9)	(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)	(9)	(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	0.023	(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)	(2)	(0.017)	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)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	23	0.242	

(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。

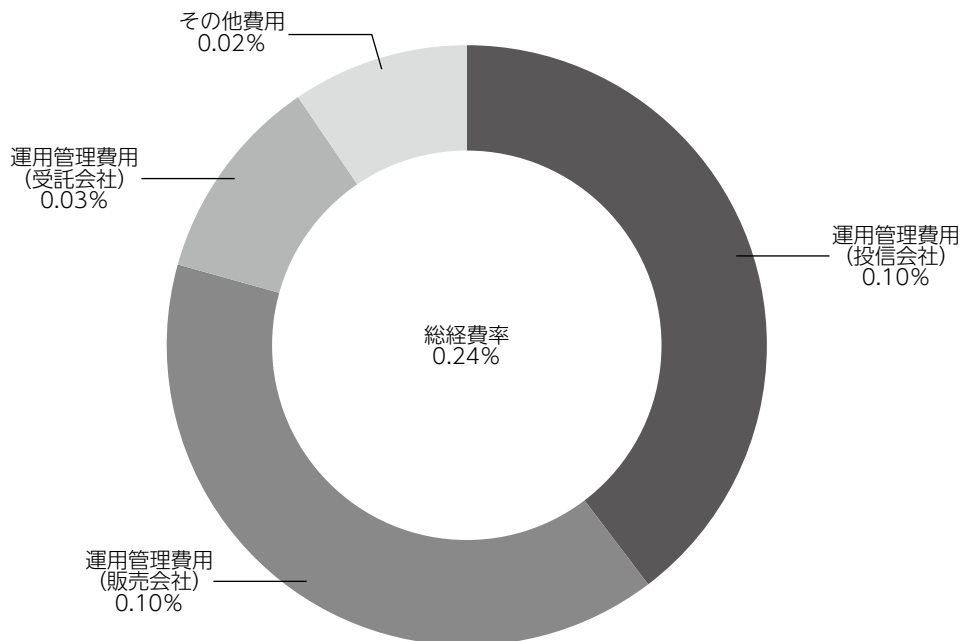
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2021年10月13日から2022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	1,864,423	2,477,331	394,792	531,211

■利害関係人との取引状況等（2021年10月13日から2022年10月12日まで）

【たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.002	百万円 0.002	% 100.0	百万円 0.002	百万円 0.002	% 100.0

【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ける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.216	百万円 0.216	% 100.0	百万円 0.216	百万円 0.216	% 100.0

平均保有割合 2.6%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■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	7,170,339	8,639,971	10,306,621

■投資信託財産の構成

2022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	10,306,621	99.8
コール・ローン等、その他	20,532	0.2
投資信託財産総額	10,327,154	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、2022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209,438,596千円、99.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=146.20円、1カナダ・ドル=106.01円、1オーストラリア・ドル=91.57円、1シンガポール・ドル=101.61円、1イギリス・ポンド=160.43円、1イスラエル・シェケル=40.79円、1デンマーク・クローネ=19.07円、1ノルウェー・クローネ=13.57円、1スウェーデン・クローナ=12.87円、1メキシコ・ペソ=7.288円、1オフショア・人民元=20.367円、1マレーシア・リンギット=31.268円、1ポーランド・ズロチ=29.231円、1ユーロ=141.84円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,327,154,436円
コール・ローン等	20,532,976
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)	10,306,621,460
(B) 負 債	19,972,385
未 払 解 約 金	8,362,650
未 払 信 託 報 酬	11,421,932
そ の 他 未 払 費 用	187,803
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	10,307,182,051
元 本	12,112,229,555
次 期 繰 越 損 益 金	△1,805,047,504
(D) 受 益 権 総 口 数	12,112,229,555口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,510円

(注) 期首における元本額は10,029,618,972円、当期中における追加設定元本額は4,539,473,098円、同解約元本額は2,456,862,515円です。

■損益の状況

当期 自2021年10月13日 至2022年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△5,032円
受 取 利 息	531
支 払 利 息	△5,563
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,717,831,662
売 買 益 損	146,020,384
買 買 損 益	△1,863,852,046
(C) 信 託 報 酬 等	△23,342,716
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,741,179,410
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△27,084,639
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△36,783,455
(配 当 等 相 当 額)	(920,434,656)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△957,218,111)
(G) 合 計(D+E+F)	△1,805,047,504
次 期 繰 越 損 益 金(G)	△1,805,047,504
追 加 信 託 差 損 益 金	△36,783,455
(配 当 等 相 当 額)	(924,261,649)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△961,045,104)
分 配 準 備 積 立 金	521,678,562
繰 越 損 益 金	△2,289,942,611

(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	175,875,155円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	924,261,649
(d) 分 配 準 備 積 立 金	345,803,407
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	1,445,940,211
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,193.79
(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15期（決算日 2022年6月22日）

（計算期間 2021年6月23日～2022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15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			
11期 (2018年6月22日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
15期 (2022年6月22日)	14,333	△2.2	415.85	△2.1	97.9	—	573,974
	12,469	△13.0	361.76	△13.0	104.3	—	375,850

(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）。

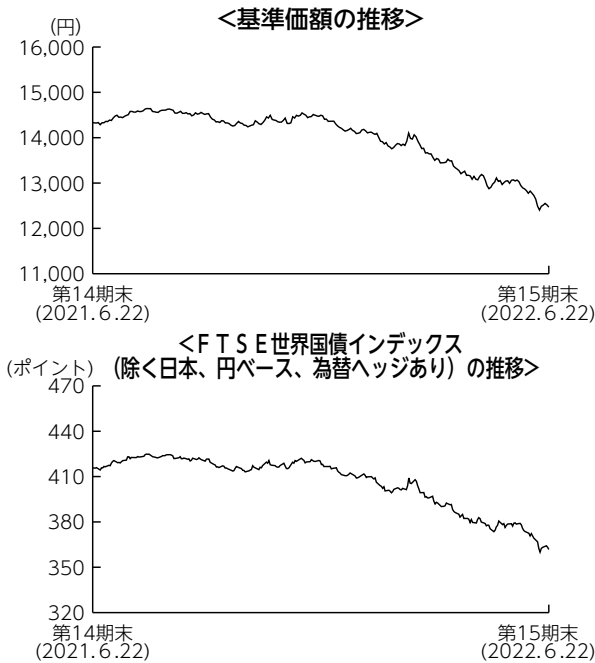
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2021 年 6 月 22 日	円 14,333	% -	ポイント 415.85	% -	% 97.9	% -
6 月 末	14,329	△0.0	415.77	△0.0	97.6	-
7 月 末	14,578	1.7	423.02	1.7	97.4	-
8 月 末	14,582	1.7	423.13	1.8	98.5	-
9 月 末	14,352	0.1	416.47	0.2	90.9	-
10 月 末	14,346	0.1	416.21	0.1	100.5	-
11 月 末	14,435	0.7	418.85	0.7	96.7	-
12 月 末	14,304	△0.2	415.09	△0.2	100.4	-
2022 年 1 月 末	14,123	△1.5	409.98	△1.4	97.7	-
2 月 末	13,830	△3.5	401.33	△3.5	98.1	-
3 月 末	13,459	△6.1	390.67	△6.1	102.4	-
4 月 末	13,160	△8.2	382.14	△8.1	134.0	-
5 月 末	13,032	△9.1	378.13	△9.1	98.7	-
(期 末) 2022 年 6 月 22 日	12,469	△13.0	361.76	△13.0	104.3	-

(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（2021年6月23日から2022年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は12,469円となり、前期末比で13.0%下落しました。

基準価額の主な変動要因

記録的なインフレに収束の兆しが見えない中、F R B（米連邦準備理事会）が2022年6月に通常の3倍となる0.75%の利上げを実施したこと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、F R B高官からインフレを抑制するため利上げペースを早める旨の発言が相次いだこと、ロシアによるウクライナへの侵攻を受けて利回りは上昇しました。ドイツ国債についてもE C B（欧州中央銀行）の利上げ観測や、ユーロ圏インフレ率の加速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13.0%下落しました。
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で0.0%と、ほぼ同程度の運用成果となりました。

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	0.016%	(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)	(0.002)	
合 計	2	0.016	
期中の平均基準価額は13,992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 (2021年6月23日から2022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 4,914,654	千アメリカ・ドル 5,494,081 (-)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 251,989	千カナダ・ドル 291,768 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 229,921	千オーストラリア・ドル 296,314 (-)
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 57,753	千シンガポール・ドル 65,595 (-)
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 441,626	千イギリス・ポンド 526,508 (-)
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シュケル 128,140	千イスラエル・シュケル 156,134 (-)
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 292,058	千デンマーク・クローネ 343,759 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 224,531	千ノルウェー・クローネ 263,883 (-)
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 254,669	千スウェーデン・クローナ 311,356 (-)
国	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 1,475,444	千メキシコ・ペソ 1,754,228 (-)

			買 付 額	売 付 額	
外	中 国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 812,249	千オフショア・人民元 410,496 (-)	
	マレーシア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 193,451	千マレーシア・リンギット 224,237 (-)	
	ポーランド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 196,938	千ポーランド・ズロチ 242,904 (-)	
国	ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 64,945	千ユーロ 77,716 (-)	
		オランダ	国 債 証 券	166,662	191,731 (-)
		ベルギー	国 債 証 券	195,612	227,273 (-)
		フランス	国 債 証 券	899,229	1,038,475 (-)
		ドイツ	国 債 証 券	675,576	785,447 (-)
		スペイン	国 債 証 券	535,122	613,902 (-)
		イタリア	国 債 証 券	803,076	935,537 (-)
		フィンランド	国 債 証 券	51,778	60,641 (-)
		オーストリア	国 債 証 券	125,003	143,931 (-)

(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（2021年6月23日から2022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 1,610,280	千アメリカ・ドル 1,464,100	千円 199,835,047	% 53.2	% -	% 23.2	% 19.5	% 10.4
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 84,590	千カナダ・ドル 75,656	千円 7,974,905	2.1	-	1.0	0.6	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 69,660	千オーストラリア・ドル 62,081	千円 5,879,760	1.6	-	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 18,370	千シンガポール・ドル 17,637	千円 1,735,324	0.5	-	0.3	0.2	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 120,060	千イギリス・ポンド 116,205	千円 19,420,263	5.2	-	3.9	0.7	0.6
イスラエル	千イスラエル・シケル 40,350	千イスラエル・シケル 39,620	千円 1,565,167	0.4	-	0.2	0.2	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 78,970	千デンマーク・クローネ 77,252	千円 1,490,202	0.4	-	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 63,300	千ノルウェー・クローネ 58,971	千円 814,395	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 81,210	千スウェーデン・クローナ 79,682	千円 1,070,927	0.3	-	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 481,838	千メキシコ・ペソ 445,355	千円 3,012,696	0.8	-	0.4	0.4	-
中 国	千オフショア・人民元 399,450	千オフショア・人民元 402,732	千円 8,203,301	2.2	-	1.0	1.0	0.2
マレーシア	千マレーシア・リンギット 66,970	千マレーシア・リンギット 65,034	千円 2,017,579	0.5	-	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 67,350	千ポーランド・ズロチ 53,359	千円 1,651,407	0.4	-	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	19,810	18,137	2,602,024	0.7	-	0.5	0.2	0.0
オランダ	48,210	46,466	6,666,083	1.8	-	1.1	0.5	0.2
ベルギー	56,600	54,720	7,850,197	2.1	-	1.6	0.5	0.0
フランス	246,200	238,979	34,284,051	9.1	-	5.6	2.7	0.9
ドイツ	183,330	179,638	25,770,977	6.9	-	4.1	1.8	1.0
スペイン	149,420	143,687	20,613,341	5.5	-	3.4	1.5	0.5
イタリア	235,800	225,079	32,289,916	8.6	-	4.9	2.5	1.2
フィンランド	15,780	14,438	2,071,402	0.6	-	0.3	0.1	0.1
オーストラリア	37,160	35,232	5,054,427	1.3	-	0.8	0.5	0.1
合 計	-	-	千円 391,873,402	104.3	-	54.2	33.9	16.1

(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										
				額	価	額												
銘	柄	率	面	金	額	外	貨	建	金	額	額	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 2.625 01/31/26	国	債	証	券	2.6250	1,280	1,246	170,141										2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国	債	証	券	2.5000	6,000	5,879	802,433										2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国	債	証	券	2.2500	6,160	6,073	829,020										2024/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国	債	証	券	2.5000	10,000	9,900	1,351,357										2024/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24	国	債	証	券	0.1250	10,000	9,542	1,302,519										2024/01/15
US T N/B 0.875 01/31/24	国	債	証	券	0.8750	6,000	5,785	789,701										2024/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国	債	証	券	1.5000	13,290	12,216	1,667,418										2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国	債	証	券	1.7500	10,000	9,035	1,233,208										2029/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国	債	証	券	0.7500	10,270	8,875	1,211,420										2028/01/31
US T N/B 1.125 01/15/25	国	債	証	券	1.1250	2,940	2,782	379,774										2025/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国	債	証	券	6.0000	1,810	1,970	268,953										2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国	債	証	券	3.1250	1,310	1,214	165,713										2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国	債	証	券	3.1250	2,760	2,538	346,428										2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国	債	証	券	2.5000	5,270	4,300	587,018										2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国	債	証	券	3.5000	890	898	122,652										2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国	債	証	券	5.3750	2,290	2,639	360,325										2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国	債	証	券	4.5000	1,410	1,610	219,799										2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国	債	証	券	4.7500	2,470	2,878	392,941										2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国	債	証	券	3.6250	5,660	5,620	767,161										2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国	債	証	券	3.0000	5,450	4,986	680,583										2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国	債	証	券	2.2500	11,790	9,265	1,264,681										2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国	債	証	券	4.3750	1,890	2,128	290,564										2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国	債	証	券	4.6250	2,790	3,215	438,850										2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国	債	証	券	2.3750	9,980	8,179	1,116,447										2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国	債	証	券	1.8750	13,740	9,818	1,340,158										2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国	債	証	券	1.6250	7,900	7,416	1,012,269										2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国	債	証	券	2.5000	4,440	3,630	495,512										2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国	債	証	券	3.0000	6,430	5,783	789,456										2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国	債	証	券	3.0000	5,830	5,280	720,701										2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国	債	証	券	2.7500	3,470	3,447	470,493										2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国	債	証	券	2.0000	9,000	8,695	1,186,855										2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国	債	証	券	2.6250	7,530	7,184	980,636										2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国	債	証	券	2.7500	9,000	8,693	1,186,567										2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国	債	証	券	2.2500	8,770	8,329	1,136,932										2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国	債	証	券	2.1250	5,000	4,915	670,906										2024/02/29
US T N/B 2.5 02/28/26	国	債	証	券	2.5000	5,520	5,346	729,762										2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国	債	証	券	2.7500	6,290	6,199	846,180										2025/02/28
US T N/B 2.375 02/29/24	国	債	証	券	2.3750	5,800	5,725	781,530										2024/02/29
US T N/B 1.125 02/15/31	国	債	証	券	1.1250	14,250	11,932	1,628,618										2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国	債	証	券	1.8750	6,540	4,958	676,805										2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国	債	証	券	2.0000	8,510	6,290	858,624										2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国	債	証	券	1.8750	13,520	11,926	1,627,868										2032/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国	債	証	券	1.1250	3,840	3,463	472,671										2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国	債	証	券	1.5000	8,730	7,658	1,045,312										2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国	債	証	券	1.8750	6,690	6,251	853,301										2027/02/28
US T N/B 0.125 02/15/24	国	債	証	券	0.1250	4,870	4,634	632,587										2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国	債	証	券	1.1250	4,820	4,547	620,721										2025/02/28
US T N/B 1.5 02/29/24	国	債	証	券	1.5000	8,520	8,287	1,131,142										2024/02/29
US T N/B 1.125 02/29/28	国	債	証	券	1.1250	12,380	10,931	1,491,993										2028/02/29
US T N/B 1.875 02/28/29	国	債	証	券	1.8750	10,000	9,105	1,242,805										2029/02/28
US T N/B 0.5 02/28/26	国	債	証	券	0.5000	10,350	9,307	1,270,411										2026/02/28
US T N/B 1.5 02/15/25	国	債	証	券	1.5000	9,580	9,130	1,246,281										2025/02/15

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 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	10,900	10,702	1,460,775	2024/03/31	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	4,430	4,349	593,644	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	7,000	6,715	916,541	2026/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	2,630	2,309	315,289	2027/03/31	
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	10,000	9,508	1,297,774	2024/03/15	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	9,000	8,321	1,135,847	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	6,880	6,108	833,774	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	10,640	9,640	1,315,821	2026/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/24	国債証券	2.2500	2,510	2,468	336,955	2024/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	9,400	9,032	1,232,788	2027/03/31	
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	6,100	5,848	798,309	2025/03/15	
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	3,920	3,866	527,767	2025/04/30	
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	6,860	6,714	916,424	2024/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	4,280	4,122	562,658	2026/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	5,000	4,915	670,933	2024/04/30	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	11,000	9,746	1,330,254	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	7,740	7,356	1,004,147	2024/04/15	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	5,560	4,840	660,629	2027/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	8,290	7,495	1,023,081	2026/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	6,870	6,314	861,828	2025/04/30	
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	2,280	2,235	305,106	2025/04/15	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	2,000	2,402	327,853	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	2,770	3,092	422,058	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	870	964	131,576	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	3,270	2,966	404,950	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	2,000	2,209	301,621	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	3,820	3,368	459,761	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	13,620	10,974	1,497,942	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	3,580	3,418	466,531	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,930	1,727	235,807	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	2,810	2,528	345,063	2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	360	293	40,080	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	5,440	5,059	690,530	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	5,610	3,765	513,922	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	4,730	4,231	577,608	2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	2,140	2,440	333,163	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	5,460	4,401	600,729	2041/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	9,050	8,931	1,219,022	2024/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	10,000	9,659	1,318,408	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	11,000	10,686	1,458,576	2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	9,450	8,862	1,209,619	2029/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	5,000	4,765	650,433	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	1,450	1,737	237,136	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	10,000	9,339	1,274,795	2026/05/15	
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	5,460	5,393	736,181	2023/05/31	
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	8,440	8,250	1,126,146	2024/05/31	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	9,150	5,528	754,647	2050/05/15	
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	5,000	4,764	650,246	2026/05/31	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	14,320	12,467	1,701,668	2031/05/15	
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	7,220	7,205	983,533	2023/05/31	
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	4,550	4,489	612,732	2025/05/31	
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	4,830	4,195	572,591	2027/05/31	
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	10,850	9,597	1,309,916	2028/05/31	
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	10,750	10,167	1,387,771	2024/05/15	
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	12,420	10,104	1,379,142	2030/05/15	

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 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	7,000	6,314		861,827	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	8,970	8,189		1,117,761	2025/05/31
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	6,710	6,552		894,382	2024/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,150	1,129		154,192	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	4,920	4,638		633,101	2026/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	6,760	6,564		896,001	2024/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	5,170	4,481		611,630	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	10,000	8,830		1,205,270	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	8,990	8,186		1,117,377	2025/06/30
US T N/B 0.25 06/15/24	国債証券	0.2500	11,000	10,375		1,416,115	2024/06/15
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	6,250	5,655		771,921	2026/06/30
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	6,170	6,033		823,524	2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	8,400	8,236		1,124,212	2023/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	3,270	3,222		439,836	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	5,000	4,708		642,595	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	8,000	7,757		1,058,821	2024/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	8,860	8,832		1,205,522	2023/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	9,000	8,728		1,191,365	2023/07/15
US T N/B 0.125 07/31/23	国債証券	0.1250	1,850	1,792		244,635	2023/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	10,670	9,262		1,264,292	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	5,000	4,296		586,427	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	8,980	8,152		1,112,687	2025/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	8,000	7,149		975,775	2026/07/31
US T N/B 0.375 07/15/24	国債証券	0.3750	9,000	8,489		1,158,736	2024/07/15
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	2,390	2,479		338,494	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	3,000	3,053		416,763	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	2,580	2,690		367,192	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	3,000	2,602		355,215	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	3,650	3,338		455,725	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	2,510	2,856		389,936	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	4,000	3,971		542,121	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	15,110	11,145		1,521,315	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	2,400	2,102		286,936	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	10,000	9,589		1,308,917	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	4,900	4,209		574,594	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	7,430	5,830		795,847	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	5,000	4,970		678,397	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	4,000	3,927		536,128	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	5,510	4,274		583,375	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	8,070	7,327		1,000,104	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	6,190	5,850		798,537	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	7,990	7,396		1,009,530	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	8,860	8,590		1,172,549	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	3,000	2,943		401,824	2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	7,880	7,726		1,054,618	2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	8,400	7,478		1,020,757	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	7,030	6,830		932,313	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	7,030	7,008		956,601	2023/08/31
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	14,040	10,316		1,408,045	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	6,760	4,500		614,297	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	11,760	7,356		1,004,079	2050/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	17,690	14,831		2,024,414	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	16,280	13,156		1,795,699	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	4,750	4,371		596,714	2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	5,400	5,173		706,182	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 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	9,920	8,979		1,225,669	2025/08/31
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	10,000	9,408		1,284,232	2024/08/15
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	8,310	8,037		1,097,103	2023/08/15
US T N/B 0.125 08/31/23	国債証券	0.1250	11,040	10,665		1,455,757	2023/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	9,870	8,616		1,176,025	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	9,520	8,210		1,120,668	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	10,000	8,966		1,223,878	2026/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	2,000	1,977		269,844	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,400	2,344		319,975	2024/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	7,810	7,788		1,063,072	2023/09/30
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	6,120	5,903		805,723	2023/09/15
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	7,670	6,557		895,040	2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	3,820	3,550		484,568	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	10,000	8,785		1,199,192	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	10,000	9,026		1,232,035	2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	6,490	6,239		851,563	2024/09/30
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	10,000	9,382		1,280,660	2024/09/15
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	6,560	6,415		875,718	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	3,620	3,576		488,149	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	5,100	4,730		645,659	2026/10/31
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	10,000	9,615		1,312,436	2023/10/15
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	7,000	6,190		844,883	2028/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	8,000	7,679		1,048,157	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	6,000	5,149		702,848	2027/10/31
US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	0.6250	10,000	9,417		1,285,458	2024/10/15
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	7,500	6,750		921,387	2025/10/31
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,700	1,880		256,722	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	3,000	3,396		463,532	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	40	35		4,886	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	3,320	3,632		495,859	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	4,920	4,258		581,241	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	80	74		10,140	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	4,000	4,051		553,040	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	4,880	4,200		573,341	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	8,770	5,873		801,721	2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	11,990	8,580		1,171,131	2051/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	2,370	2,125		290,147	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	4,030	3,539		483,059	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	10,000	9,757		1,331,843	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,200	1,341		183,084	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	5,050	4,938		674,035	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	3,120	2,519		343,939	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	7,560	7,281		993,854	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	7,380	7,256		990,376	2028/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	2,500	2,487		339,545	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	10,580	9,968		1,360,579	2026/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	8,040	7,578		1,034,451	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	8,000	7,886		1,076,479	2023/11/30
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	6,670	6,495		886,561	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	4,140	4,070		555,577	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	8,670	8,639		1,179,208	2023/11/30
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	10,970	7,619		1,040,035	2040/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	6,400	4,913		670,643	2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	5,310	4,922		671,848	2026/11/30
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	6,900	6,192		845,174	2029/11/15

銘柄	当				期			末
	種類	利率	額面金額	評価額			償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	20,420	17,237	2,352,726		2031/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	18,710	15,388	2,100,441		2030/11/15	
US T N/B 0.25 11/15/23	国債証券	0.2500	12,280	11,806	1,611,410		2023/11/15	
US T N/B 0.5 11/30/23	国債証券	0.5000	2,000	1,925	262,860		2023/11/30	
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	8,510	7,331	1,000,639		2027/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	7,000	6,230	850,407		2028/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	7,100	6,802	928,423		2024/11/30	
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	9,020	8,133	1,110,141		2025/11/30	
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	4,040	3,803	519,109		2024/11/15	
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	8,000	7,891	1,077,119		2023/12/31	
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,000	1,949	266,038		2025/12/31	
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	7,210	7,032	959,874		2024/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	4,990	4,647	634,340		2026/12/31	
US T N/B 0.75 12/31/23	国債証券	0.7500	4,940	4,765	650,398		2023/12/31	
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	9,100	8,280	1,130,225		2026/12/31	
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	6,900	6,094	831,857		2028/12/31	
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	8,400	7,558	1,031,595		2025/12/31	
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	10,160	8,740	1,192,974		2027/12/31	
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	9,760	9,224	1,259,082		2024/12/15	
小計	—	—	1,610,280	1,464,100	199,835,047		—	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円			
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	4,010	3,850	405,886		2024/02/01	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	2,400	2,359	248,735		2024/03/01	
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	2,200	2,082	219,522		2025/03/01	
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	2,200	1,963	206,954		2026/03/01	
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	2,380	2,157	227,468		2027/03/01	
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	2,600	2,464	259,807		2024/04/01	
CANADA 1.5 04/01/25	国債証券	1.5000	2,080	1,976	208,381		2025/04/01	
CANADA 1.5 05/01/24	国債証券	1.5000	1,000	967	101,948		2024/05/01	
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,900	1,770	186,609		2026/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,440	1,642	173,177		2029/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	1,190	1,391	146,646		2037/06/01	
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,090	1,073	113,153		2024/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	600	640	67,526		2041/06/01	
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,110	1,092	115,208		2023/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,260	1,221	128,803		2025/06/01	
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	1,610	1,435	151,353		2027/06/01	
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	1,910	1,768	186,454		2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	5,690	4,808	506,896		2030/06/01	
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	7,200	6,094	642,398		2031/06/01	
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	1,500	1,311	138,265		2032/06/01	
CANADA 0.25 08/01/23	国債証券	0.2500	810	784	82,642		2023/08/01	
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	800	769	81,098		2024/09/01	
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	2,220	2,187	230,636		2023/09/01	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	3,990	3,647	384,457		2025/09/01	
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,660	1,505	158,698		2026/09/01	
CANADA 0.75 10/01/24	国債証券	0.7500	3,250	3,067	323,329		2024/10/01	
CANADA 0.5 11/01/23	国債証券	0.5000	3,490	3,362	354,423		2023/11/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	1,920	1,926	203,098		2045/12/01	
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	1,120	988	104,166		2048/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	7,720	5,722	603,220		2051/12/01	
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	2,650	1,816	191,456		2053/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	780	666	70,307		2064/12/01	
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	4,500	3,514	370,453		2030/12/01	
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	4,310	3,621	381,716		2031/12/01	
小計	—	—	84,590	75,656	7,974,905		—	

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
(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	3,690	2,975	281,770		2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	1,440	1,428	135,276		2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	2,760	2,877	272,574		2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	2,100	2,084	197,469		2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	3,170	3,232	306,109		2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	3,500	3,359	318,184		2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	3,290	3,407	322,751		2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	1,830	1,740	164,830		2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	2,000	1,828	173,215		2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	4,540	4,083	386,710		2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	1,890	1,523	144,262		2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	3,220	2,487	235,583		2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	2,670	2,353	222,870		2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	2,320	1,877	177,844		2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	1,140	978	92,681		2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	810	474	44,924		2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	3,290	2,874	272,252		2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	950	888	84,162		2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	2,120	2,007	190,143		2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	2,060	1,898	179,845		2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	3,000	2,697	255,433		2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	2,190	1,759	166,683		2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	3,470	2,646	250,678		2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	3,500	3,120	295,526		2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	4,500	4,175	395,486		2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	4,210	3,299	312,490		2030/12/21
小計	—	—	69,660	62,081	5,879,760		—
(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	750	743	73,201		2024/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	1,430	1,462	143,907		2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	1,100	1,027	101,085		2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	770	600	59,093		2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	1,160	1,090	107,328		2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	1,180	1,156	113,754		2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	1,140	1,125	110,740		2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	1,380	1,339	131,772		2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	1,330	1,312	129,157		2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	260	233	22,946		2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	660	662	65,171		2023/07/01
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	400	354	34,830		2031/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	1,120	1,004	98,850		2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	1,050	1,055	103,888		2024/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	1,200	1,179	116,001		2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	1,600	1,634	160,808		2033/09/01
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	400	317	31,215		2051/10/01
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500	830	772	76,053		2026/11/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	610	564	55,516		2025/11/01
小計	—	—	18,370	17,637	1,735,324		—
(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	3,080	3,240	541,625		2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	3,530	3,866	646,178		2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	2,340	3,015	503,901		2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	1,300	1,030	172,247		2049/01/22
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	2,970	1,939	324,064		2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	1,360	1,043	174,462		2039/01/31

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
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 1.0 01/31/32	国債証券	1.0000	770	662	110,659		2032/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	5,940	5,730	957,700		2024/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	1,550	1,364	228,104		2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,790	1,579	264,037		2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25	国債証券	0.2500	960	907	151,632		2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,740	1,609	268,979		2026/01/30
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	2,270	2,424	405,101		2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	2,120	2,456	410,613		2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	2,490	2,432	406,559		2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	2,960	3,377	564,399		2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	2,110	2,010	335,961		2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	2,980	2,245	375,253		2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	1,270	870	145,530		2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	2,160	2,554	426,973		2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53	国債証券	1.5000	670	488	81,633		2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	2,210	1,696	283,582		2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	2,150	2,034	339,987		2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	1,970	2,371	396,334		2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	2,780	2,691	449,795		2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	2,000	1,898	317,260		2027/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	3,400	3,345	559,160		2023/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	2,560	2,112	353,064		2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,680	1,363	227,826		2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	2,920	2,211	369,550		2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	1,720	2,036	340,382		2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	910	908	151,897		2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	2,000	2,015	336,847		2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	1,800	1,780	297,585		2025/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	3,760	3,236	540,906		2037/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	2,120	1,587	265,327		2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	1,810	846	141,448		2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	2,440	1,746	291,855		2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73	国債証券	1.1250	710	411	68,700		2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	2,590	1,961	327,790		2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	1,430	818	136,843		2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	1,320	1,263	211,175		2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	3,120	2,794	467,067		2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	2,240	1,886	315,201		2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	3,340	3,065	512,285		2026/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	1,450	1,759	294,124		2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	2,060	2,567	429,002		2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	3,010	3,743	625,670		2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	2,060	2,542	424,946		2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	3,170	4,153	694,115		2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	3,000	3,284	548,825		2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,190	1,418	236,985		2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	2,500	2,932	490,102		2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	2,280	2,866	478,991		2049/12/07
小計	-	-	120,060	116,205	19,420,263		-
(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	2,330	2,983	117,847		2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国債証券	0.5000	3,170	2,913	115,095		2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	5,110	5,183	204,773		2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	360	346	13,683		2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	3,360	3,439	135,861		2024/03/31

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 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	2,810	2,424	95,761	2030/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	国債証券	1.3000	2,690	2,283	90,207	2032/04/30	
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	4,380	4,121	162,826	2025/04/30	
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	1,370	1,071	42,311	2037/05/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,330	2,260	89,290	2025/08/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	1,620	1,557	61,517	2028/09/28	
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	3,700	4,208	166,254	2026/10/30	
ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	国債証券	0.4000	5,490	5,209	205,803	2024/10/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	国債証券	1.5000	1,630	1,618	63,934	2023/11/30	
小計	-	-	40,350	39,620	1,565,167	-	
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円		
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	7,060	3,939	75,991	2052/11/15	
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	18,120	23,727	457,700	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	6,330	6,353	122,566	2025/11/15	
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	3,600	3,626	69,962	2023/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	5,450	5,062	97,656	2027/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	18,520	16,608	320,371	2029/11/15	
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	8,860	7,278	140,410	2031/11/15	
DENMARK 0.0 11/15/24	国債証券	0.0000	11,030	10,655	205,543	2024/11/15	
小計	-	-	78,970	77,252	1,490,202	-	
(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	4,220	3,975	54,905	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	9,840	9,219	127,328	2027/02/17	
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	12,770	12,800	176,774	2024/03/14	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	1,250	1,205	16,643	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	13,360	12,553	173,357	2028/04/26	
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	5,560	4,992	68,943	2032/05/18	
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	8,130	7,017	96,915	2030/08/19	
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	5,720	5,157	71,231	2029/09/06	
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,450	2,048	28,294	2031/09/17	
小計	-	-	63,300	58,971	814,395	-	
(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	6,290	7,714	103,684	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	12,680	11,752	157,947	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	16,220	16,349	219,743	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	6,650	5,687	76,436	2031/05/12	
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	7,530	7,796	104,783	2032/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	5,230	5,205	69,961	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	21,800	20,773	279,197	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	4,810	4,402	59,172	2029/11/12	
小計	-	-	81,210	79,682	1,070,927	-	
(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	63,554	56,014	378,924	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	20,000	17,032	115,219	2027/03/04	
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	19,510	17,383	117,593	2025/03/06	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	47,501	45,711	309,223	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.5 05/29/31	国債証券	7.7500	63,290	57,776	390,840	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	54,445	50,476	341,458	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	38,590	37,354	252,693	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	24,328	21,114	142,833	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	37,956	33,559	227,019	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	41,653	39,190	265,108	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	16,011	14,312	96,819	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	55,000	55,429	374,962	2024/12/05	
小計	-	-	481,838	445,355	3,012,696	-	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額	
				邦貨換算金額	外貨換算金額		
(中国)		%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円		
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	国債証券	2.3700	25,000	24,759	504,326	2027/01/20	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	17,000	16,888	343,999	2032/02/17	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	52,000	51,861	1,056,381	2025/02/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	18,000	18,012	366,896	2029/03/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	国債証券	2.2800	25,000	25,008	509,395	2024/03/17	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	12,950	13,855	282,223	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 04/15/27	国債証券	2.4800	10,000	9,950	202,679	2027/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	21,500	21,773	443,504	2031/05/27	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国債証券	3.0100	22,000	22,404	456,361	2028/05/13	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	23,500	23,253	473,660	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	56,500	56,740	1,155,762	2026/08/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	34,000	34,124	695,077	2024/09/02	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	24,400	25,349	516,337	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	15,500	15,697	319,748	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	国債証券	2.5600	18,600	18,699	380,897	2023/10/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	23,500	24,353	496,050	2027/12/03	
小計	-	-	399,450	402,732	8,203,301	-	
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円		
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	1,370	1,362	42,255	2027/03/15	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	1,480	1,439	44,652	2046/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	2,030	2,067	64,131	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	3,050	3,085	95,732	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	3,510	3,302	102,459	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	3,640	3,655	113,417	2037/04/07	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	2,090	1,829	56,746	2031/04/15	
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	200	195	6,051	2027/05/31	
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	3,750	3,287	102,002	2040/05/22	
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	1,370	1,318	40,911	2035/05/31	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	5,090	4,951	153,619	2028/06/15	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	4,200	4,156	128,951	2031/06/30	
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	1,030	1,048	32,523	2038/06/08	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,830	1,832	56,845	2024/06/14	
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	4,520	3,877	120,303	2050/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	3,500	3,558	110,389	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	2,400	2,381	73,880	2048/07/06	
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	1,810	1,808	56,094	2026/07/15	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,860	1,712	53,117	2034/07/05	
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	3,910	3,808	118,153	2029/08/15	
MALAYSIA 3.8 08/17/23	国債証券	3.8000	1,070	1,082	33,584	2023/08/17	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	4,750	4,783	148,399	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	580	583	18,101	2043/09/30	
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	1,920	1,944	60,319	2024/09/30	
MALAYSIA 4.696 10/15/42	国債証券	4.6960	920	904	28,047	2042/10/15	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	3,090	3,078	95,511	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	2,000	1,978	61,374	2027/11/16	
小計	-	-	66,970	65,034	2,017,579	-	
(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 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	11,010	8,483	262,562	2028/04/25	
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	2,200	1,282	39,688	2032/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	7,510	6,832	211,451	2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	8,370	6,932	214,564	2025/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	9,000	7,309	226,215	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,440	2,133	66,030	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	6,690	5,193	160,720	2027/07/25	
POLAND 07/25/24	国債証券	0.0000	2,220	1,892	58,555	2024/07/25	

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		
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円		
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	1,070	1,023	31,673	2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	4,360	3,190	98,746	2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	4,690	4,149	128,414	2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	6,690	4,138	128,089	2030/10/25	
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,100	797	24,695	2026/10/25	
小計	—	—	67,350	53,359	1,651,407	—	
(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	2,460	2,172	311,611	2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	1,420	1,323	189,871	2031/03/18	
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	60	62	8,955	2024/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	1,170	1,295	185,832	2025/03/13	
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	50	34	4,916	2041/04/22	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	80	60	8,639	2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	70	62	8,943	2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	2,610	2,675	383,898	2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	100	94	13,498	2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	420	394	56,584	2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	4,980	4,869	698,510	2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	130	116	16,735	2037/05/15	
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	3,670	2,818	404,366	2035/05/15	
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	930	750	107,645	2031/10/18	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	1,660	1,408	202,014	2030/10/18	
小計	—	—	19,810	18,137	2,602,024	—	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	2,410	2,958	424,380	2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	3,480	3,840	550,972	2047/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	2,240	1,177	168,957	2052/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	980	1,171	168,062	2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	3,260	3,985	571,738	2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,620	1,683	241,538	2033/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	1,660	1,173	168,357	2038/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,450	1,082	155,302	2040/01/15	
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	4,330	4,263	611,643	2024/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	990	875	125,575	2029/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	2,860	2,647	379,846	2027/01/15	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	680	687	98,629	2023/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	2,000	1,914	274,625	2026/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	3,960	4,024	577,379	2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	3,770	3,633	521,314	2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	4,460	4,191	601,323	2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	2,330	2,219	318,354	2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,110	991	142,186	2029/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	3,640	3,123	448,053	2030/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	980	821	117,841	2031/07/15	
小計	—	—	48,210	46,466	6,666,083	—	
(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	2,140	2,571	368,924	2028/03/28	
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,860	2,243	321,855	2041/03/28	
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	2,200	2,435	349,342	2026/03/28	
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	1,950	2,240	321,455	2032/03/28	
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	3,430	4,355	624,783	2035/03/28	
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	2,400	2,152	308,765	2033/04/22	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	2,240	2,576	369,591	2045/06/22	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	630	486	69,850	2047/06/22	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	2,650	2,046	293,623	2050/06/22	

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
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	160	110	15,850		2053/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	870	750	107,665		2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	740	608	87,348		2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	1,040	443	63,613		2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	3,000	2,923	419,426		2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	850	873	125,321		2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	2,110	1,899	272,503		2031/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	2,000	1,879	269,676		2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	1,120	747	107,167		2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	2,400	2,225	319,201		2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	1,540	1,618	232,211		2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	2,120	1,908	273,850		2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	2,750	2,692	386,277		2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	3,830	3,643	522,759		2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	310	263	37,858		2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	3,100	2,638	378,550		2030/06/22
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	5,100	5,006	718,222		2024/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	3,190	2,582	370,416		2031/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	70	69	9,963		2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	800	725	104,122		2027/10/22
小計	-	-	56,600	54,720	7,850,197		-
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	1,640	1,506	216,186		2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	8,050	7,582	1,087,723		2026/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	5,000	4,922	706,180		2024/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	国債証券	0.0000	3,500	3,364	482,607		2025/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	2,000	1,964	281,792		2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	2,310	2,217	318,190		2025/03/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	6,430	6,871	985,819		2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	5,040	6,349	910,913		2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	4,040	5,018	719,952		2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	3,110	3,930	563,835		2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	4,460	5,457	782,953		2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	4,900	6,120	878,100		2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	4,690	5,095	731,033		2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	4,280	3,697	530,431		2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	5,420	4,111	589,786		2050/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	3,610	2,133	306,023		2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	1,420	817	117,237		2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	1,930	1,425	204,499		2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	1,510	603	86,532		2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	6,880	7,021	1,007,373		2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	8,620	8,905	1,277,614		2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,900	5,515	791,273		2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	8,910	8,427	1,209,061		2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	7,760	7,537	1,081,263		2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	13,600	12,293	1,763,672		2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	3,300	2,884	413,790		2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	6,220	5,940	852,176		2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	8,000	7,690	1,103,234		2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	2,270	1,572	225,529		2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	5,240	4,447	637,993		2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	1,160	955	137,008		2038/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	1,200	954	136,895		2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	5,750	5,102	731,987		2039/06/25

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		
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	2,880	1,831	262,723	2044/06/25	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	8,000	8,373	1,201,259	2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	6,320	7,234	1,037,895	2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	6,390	6,677	957,972	2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	3,530	4,198	602,324	2038/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	7,690	10,104	1,449,629	2032/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	6,990	7,056	1,012,363	2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	6,200	6,077	871,870	2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	7,530	7,045	1,010,697	2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	9,010	8,342	1,196,767	2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	7,570	6,133	879,915	2031/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	9,180	7,656	1,098,465	2030/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	6,760	5,809	833,491	2029/11/25	
小計	-	-	246,200	238,979	34,284,051	-	
(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	1,279	183,500	2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	2,200	2,669	383,023	2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	2,930	3,880	556,686	2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	3,340	4,345	623,358	2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	4,600	5,788	830,362	2037/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	4,330	4,244	608,975	2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	6,490	6,283	901,373	2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	5,540	5,068	727,062	2029/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	4,470	4,207	603,630	2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	3,000	3,041	436,264	2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	4,650	4,390	629,918	2027/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	3,300	2,853	409,378	2031/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	5,210	4,400	631,306	2032/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	3,490	3,077	441,540	2030/02/15	
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	国債証券	0.0000	1,930	1,898	272,334	2024/03/15	
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	3,490	3,429	492,032	2024/04/05	
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	4,620	4,457	639,440	2025/04/11	
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	3,100	2,937	421,409	2026/04/10	
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	2,000	1,857	266,476	2027/04/16	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	4,280	4,316	619,307	2024/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	90	70	10,071	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	4,350	3,320	476,338	2036/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,670	2,066	296,449	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	2,000	2,361	338,843	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,990	2,638	378,533	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	2,740	3,322	476,680	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	4,840	5,325	764,003	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	2,810	3,976	570,487	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	3,150	4,132	592,900	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	4,590	5,110	733,165	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	1,950	1,084	155,623	2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	5,220	4,494	644,829	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	6,640	6,568	942,362	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	5,000	4,738	679,791	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	3,680	3,466	497,310	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	3,500	3,222	462,362	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	3,730	3,788	543,540	2023/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	6,600	6,578	943,715	2024/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	3,930	3,499	502,093	2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	3,660	2,131	305,716	2050/08/15	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	5,610	4,795	687,960	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	2,370	1,383	198,481	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	5,000	4,368	626,748	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	820	717	102,906	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	1,000	856	122,883	2031/08/15	
BUNDESSCHAT 0.0 09/15/23	国債証券	0.0000	3,000	2,974	426,765	2023/09/15	
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	3,940	3,905	560,275	2023/10/13	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	3,720	3,489	500,610	2026/10/09	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	2,000	1,916	274,918	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	4,500	4,135	593,259	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	3,000	2,710	388,833	2028/11/15	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	国債証券	0.0000	2,080	2,057	295,132	2023/12/15	
小計	-	-	183,330	179,638	25,770,977	-	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,140	1,394	200,121	2029/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	3,360	3,817	547,647	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	3,650	3,491	500,903	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	2,000	1,810	259,791	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	3,000	2,639	378,605	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	3,690	3,434	492,711	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	3,790	3,775	541,590	2025/04/30	
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	4,220	4,407	632,351	2024/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	4,340	4,210	604,031	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	2,770	2,765	396,764	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	3,530	3,357	481,718	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	3,930	3,691	529,638	2029/04/30	
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	5,090	4,162	597,166	2032/04/30	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	4,540	3,892	558,444	2030/04/30	
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	2,890	2,296	329,399	2031/04/30	
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	2,740	2,668	382,798	2024/05/31	
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	2,000	1,894	271,790	2025/05/31	
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	3,100	3,574	512,854	2026/07/30	
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	3,210	3,985	571,718	2040/07/30	
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	2,890	3,532	506,716	2041/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	2,460	2,401	344,575	2066/07/30	
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,250	1,356	194,587	2025/07/30	
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	3,660	3,495	501,528	2030/07/30	
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	4,810	6,076	871,765	2032/07/30	
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	470	448	64,392	2033/07/30	
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	5,000	4,733	679,032	2028/07/30	
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	3,850	3,363	482,551	2035/07/30	
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	3,060	2,982	427,835	2024/07/30	
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	270	268	38,532	2023/07/30	
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	1,810	1,309	187,841	2037/07/30	
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	1,180	797	114,469	2042/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	4,500	4,192	601,477	2027/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	1,000	890	127,693	2029/07/30	
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	3,100	3,189	457,561	2024/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	3,520	4,089	586,710	2028/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,220	1,598	229,269	2044/10/31	
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	3,480	3,267	468,747	2046/10/31	
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,650	1,476	211,861	2048/10/31	
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	780	553	79,348	2052/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	1,900	984	141,285	2071/10/31	
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	3,270	1,881	269,891	2050/10/31	

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	千円		
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円			
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	4,460	4,502	645,968		2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	5,000	4,799	688,584		2027/10/31	
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	3,540	3,430	492,185		2026/10/31	
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	2,530	2,215	317,774		2029/10/31	
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	6,420	6,702	961,543		2023/10/31	
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	3,000	2,445	350,829		2031/10/31	
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,580	1,140	163,612		2040/10/31	
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	4,770	4,287	615,121		2030/10/31	
小計	—	—	149,420	143,687	20,613,341		—	
(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	3,000	2,755	395,304		2027/01/15	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	1,850	1,806	259,222		2024/01/15	
ITALY BTPS 0.0 01/30/24	国債証券	0.0000	3,000	2,926	419,835		2024/01/30	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	2,890	3,399	487,734		2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	6,440	6,638	952,430		2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	4,200	3,999	573,802		2028/02/01	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	2,810	2,685	385,289		2025/02/01	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	4,100	3,814	547,283		2026/02/01	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	5,000	4,175	598,945		2029/02/15	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	2,650	2,194	314,779		2047/03/01	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	2,180	2,045	293,402		2048/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	5,190	5,446	781,354		2024/03/01	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	1,440	1,113	159,812		2067/03/01	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	1,380	883	126,743		2072/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,620	1,741	249,907		2025/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	3,220	3,450	494,969		2026/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	30	25	3,628		2032/03/01	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	2,770	2,516	361,059		2040/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	3,000	2,880	413,246		2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	3,860	3,922	562,694		2030/03/01	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	2,050	1,551	222,598		2036/03/01	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	3,570	2,613	374,946		2041/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	2,210	1,518	217,811		2037/03/01	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	4,610	3,934	564,396		2028/03/15	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	2,130	1,394	200,025		2045/04/30	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	4,000	3,454	495,532		2030/04/01	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	3,770	3,026	434,159		2031/04/01	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	3,420	3,097	444,366		2026/04/01	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	2,000	1,840	264,023		2027/04/01	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	4,300	5,118	734,269		2031/05/01	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	2,800	2,805	402,463		2024/05/15	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	5,490	5,362	769,323		2025/05/15	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	3,790	3,654	524,302		2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	5,910	5,780	829,280		2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	2,060	2,001	287,075		2027/06/01	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	3,250	2,523	362,039		2032/06/01	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	国債証券	0.6000	3,500	3,492	501,100		2023/06/15	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	3,540	3,466	497,343		2026/07/15	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,000	998	143,226		2024/07/01	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,500	1,290	185,192		2028/07/15	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	3,250	3,201	459,344		2025/07/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	690	773	110,984		2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	4,170	4,800	688,740		2039/08/01	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	5,830	6,064	869,993		2023/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	3,000	2,882	413,507		2027/08/01	

銘柄	当			期			償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額	千円	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	4,790	4,716	676,666		2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	3,000	2,310	331,509		2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	4,750	3,917	561,979		2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	3,710	3,681	528,090		2023/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	国債証券	0.0000	1,000	960	137,778		2024/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	2,000	1,793	257,223		2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	2,240	2,022	290,211		2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	2,810	3,192	458,053		2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	1,940	1,774	254,501		2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	5,480	5,988	859,101		2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	2,950	3,408	488,931		2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	1,770	1,346	193,160		2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	3,660	2,312	331,739		2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	2,960	2,621	376,064		2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	1,180	811	116,415		2052/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	2,000	2,078	298,168		2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	1,800	1,793	257,324		2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	2,260	1,896	272,117		2036/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	2,000	1,812	260,035		2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	3,840	3,810	546,636		2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	1,240	1,258	180,534		2023/10/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	3,400	4,018	576,439		2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	6,440	7,308	1,048,421		2029/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	1,000	985	141,344		2024/11/15
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	3,000	3,008	431,570		2025/11/01
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	3,610	3,557	510,358		2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	3,020	2,838	407,185		2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	4,090	4,129	592,374		2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	4,660	4,579	657,041		2028/12/01
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	70	55	7,925		2031/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	3,660	3,174	455,361		2030/12/01
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	国債証券	0.0000	3,000	2,845	408,150		2024/12/15
小計	—	—	235,800	225,079	32,289,916		—
(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	420	214	30,830		2052/04/15
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	3,460	3,523	505,452		2024/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	980	872	125,099		2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	330	263	37,861		2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	2,900	2,778	398,623		2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	1,900	1,656	237,687		2034/04/15
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券	0.5000	100	66	9,561		2043/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	180	131	18,869		2036/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	290	312	44,819		2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	160	167	24,050		2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	1,720	1,737	249,196		2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	1,060	951	136,494		2029/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	90	82	11,800		2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	10	9	1,339		2027/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	1,020	684	98,268		2040/09/15
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	180	149	21,404		2031/09/15
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	880	739	106,062		2030/09/15
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	100	97	13,981		2024/09/15
小計	—	—	15,780	14,438	2,071,402		—
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	1,640	2,084	299,028		2062/01/26

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 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	490	398	57,234	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	3,200	2,896	415,569	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	1,930	1,806	259,228	2028/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	1,000	825	118,461	2031/02/20
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000	1,500	1,317	189,066	2032/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	2,760	2,351	337,322	2030/02/20
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	2,360	2,842	407,836	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	740	470	67,487	2051/03/20
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	130	62	8,923	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	4,010	3,769	540,748	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	890	854	122,603	2025/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	1,660	1,668	239,317	2034/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	390	157	22,666	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	920	1,016	145,857	2044/06/20
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	20	19	2,802	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	970	754	108,266	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	3,600	3,638	521,960	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	3,230	3,100	444,789	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	500	495	71,045	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	1,540	1,122	161,100	2036/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	3,280	3,323	476,837	2023/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	400	252	36,272	2086/11/02
小計	—	—	37,160	35,232	5,054,427	—
合計	—	—	—	—	391,873,402	—

■投資信託財産の構成

2022年6月22日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	率
公社債	千円		%
コール・ローン等、その他	391,873,402		98.5
投資信託財産総額	5,999,761		1.5
	397,873,163		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、396,133,568千円、99.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.49円、1カナダ・ドル=105.41円、1オーストラリア・ドル=94.71円、1シンガポール・ドル=98.39円、1イギリス・ポンド=167.12円、1イスラエル・シェケル=39.504円、1デンマーク・クローネ=19.29円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローナ=13.44円、1メキシコ・ペソ=6.764円、1オフショア・人民元=20.369円、1マレーシア・リンギット=31.023円、1ポーランド・ズロチ=30.948円、1ユーロ=143.46円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	788,924,148,833円
コ ー ル ・ ロ ー ド 等	3,634,753,446
公 社 債(評価額)	391,873,402,035
未 収 入 金	391,051,521,204
未 収 利 息	1,445,393,884
前 払 費 用	919,078,264
(B) 負 債	413,073,939,788
未 払 金	413,067,141,788
未 払 解 約 金	6,798,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	375,850,209,045
元 本	301,416,347,543
次 期 繰 越 損 益 金	74,433,861,502
(D) 受 益 権 総 口 数	301,416,347,543口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,469円

(注1) 期首元本額 400,458,673,144円
 追加設定元本額 896,564,854,783円
 一部解約元本額 995,607,180,384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>	7,983,267,042円
たわらノーロード バランス (堅実型)	922,989,511円
たわらノーロード バランス (標準型)	2,397,639,042円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,142,290,705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)	51,823,060円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	1,480,060,981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)	1,839,784,196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)	585,887,924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)	296,552,475円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	8,098,987円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	21,432,813円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	196,275,572円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	13,786,350円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	20,674,350円
投資のソムリエ	154,657,465,328円
投資のソムリエ<DC年金>	9,674,975,477円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,729,805,477円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	49,791,164,842円
ワールドアセットバランス (基本コース)	2,318,936,250円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	1,473,306,935円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	464,088,184円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	234,326,172円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	64,705,631円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	1,502,094,089円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,690,173,872円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,045,976,355円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	564,248,623円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	239,455,331円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	154,826,999円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	27,056,178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)	19,895,820,997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)	8,036,406,080円

投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	4,004,181,571円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用)	178,452,757円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	854,354,230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)	525,449,535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)	48,155,676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)	334,162,100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)	639,323,897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)	899,271,353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)	698,032,316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)	2,403,879,369円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA (1306) (適格機関投資家限定)	3,179,279,422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)	126,409,489円
期末元本合計	301,416,347,543円

■損益の状況

当期 自2021年6月23日 至2022年6月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	9,182,555,387	円
	受取利息	9,184,824,272	
	その他の収益	241,313	
	支払利息	△2,510,198	
(B)	有価証券売買損益	△73,578,958,793	
	売買益	118,689,796,094	
	売買損	△192,268,754,887	
(C)	その他の費用	△77,317,894	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△64,473,721,300	
(E)	前期繰越損益金	173,515,474,368	
(F)	解約差損益金	△383,745,218,616	
(G)	追加信託差損益金	349,137,327,050	
(H)	計(D+E+F+G)	74,433,861,502	
	次期繰越損益金(H)	74,433,861,502	

(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。