

運用報告書 (全体版)

第2期<決算日2021年3月25日>

One DC 先進国債券インデックスファンド

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	2019年6月28日から無期限です。
運用方針	F T S E世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) に連動する投資成果を図ることを目的として、運用を行います。
主要投資対象	One DC 先進国債券インデックスファンド
	外国債券パッシブ・マザーファンド
運用方法	原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
	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。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。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
組入制限	決算日 (毎年3月25日。休業日の場合は翌営業日。) に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額を分配対象額とし、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「One DC 先進国債券インデックスファンド」は、2021年3月25日に第2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/>

One DC 先進国債券インデックスファンド

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配 金	期中 騰落 率	期中 騰落 率	期中 騰落 率			
(設定日) 2019年6月28日	円 10,000	円 -	% -	ポイント (6月27日) 115,499.03	% -	% -	% -	百万円 1
1期 (2020年3月25日)	10,516	0	5.2	121,384.25	5.1	96.2	-	1
2期 (2021年3月25日)	10,835	0	3.0	125,741.30	3.6	98.4	-	591

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

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

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています(以下同じ)。

(注5) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します(以下同じ)。

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 比率
	円	騰 落 率	ポイ ント	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 3 月 25 日	10,516	% —	ポイ ント 121,384.25	% —	% 96.2	% —
3 月 末	10,516	0.0	121,796.59	0.3	96.9	—
4 月 末	10,316	△1.9	119,329.72	△1.7	96.1	—
5 月 末	10,461	△0.5	120,973.12	△0.3	97.2	—
6 月 末	10,627	1.1	123,063.01	1.4	98.4	—
7 月 末	10,731	2.0	123,870.50	2.0	99.0	—
8 月 末	10,717	1.9	124,064.52	2.2	99.3	—
9 月 末	10,766	2.4	124,690.18	2.7	97.8	—
10 月 末	10,604	0.8	122,727.67	1.1	98.2	—
11 月 末	10,712	1.9	124,001.42	2.2	99.1	—
12 月 末	10,800	2.7	125,045.38	3.0	98.6	—
2021 年 1 月 末	10,783	2.5	125,100.34	3.1	98.6	—
2 月 末	10,686	1.6	124,359.44	2.5	99.0	—
(期 末) 2021 年 3 月 25 日	10,835	3.0	125,741.30	3.6	98.4	—

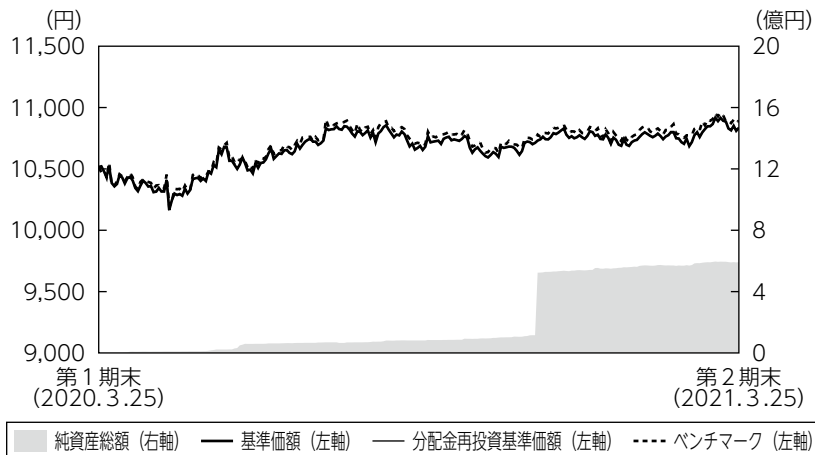
(注1) 騰落率は期首比です。

(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3月26日から2021年3月25日まで）

基準価額等の推移



第2期首：10,516円
第2期末：10,835円
(既払分配金0円)
騰落率：3.0%
(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

米国債の利回りは、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景気回復が加速するとの見方や、インフレ加速観測の高まりを背景に上昇（価格は下落）しました。ドル/円は、F R B（米連邦準備理事会）の金融政策の新戦略や追加緩和期待を受けて円高ドル安になりましたが、ユーロ/円においてユーロ圏経済指標の改善などから大きく円安に動いたことから基準価額は上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、米国債の利回りは上昇しました。一方、ドイツ債の利回りは低下（価格は上昇）しました。米国債はF R Bの金融政策の新戦略を受けて米国金融緩和の長期化観測が強まったことから利回りは低下していましたが、期後半は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伴い世界経済が正常化に向かうとの期待から利回りは上昇しました。ドイツ債については新型コロナウイルス感染再拡大に伴う欧州景気の下振れ懸念などから利回りは低下しました。

為替市場ではドル／円は円高ドル安、ユーロ／円は円安ユーロ高となりました。ドル／円は、F R Bの金融政策の新戦略や追加緩和期待を受けて円高ドル安が進む展開となりました。その後は米国債利回りの上昇や米国のインフレ期待から円安ドル高に推移しました。ユーロ／円は、ユーロ圏経済指標の改善やドイツ経済指標の上振れなどから円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

当ファンドの主要投資対象は外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドであり、マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

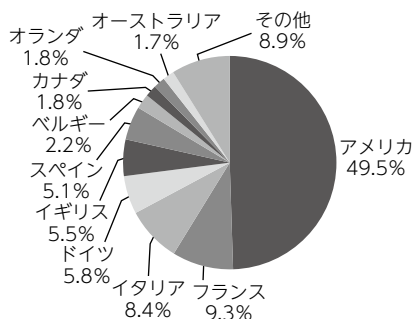
●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

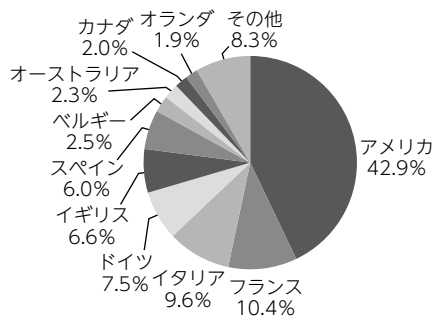
【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○国別配分

期首（前期末）



期末



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

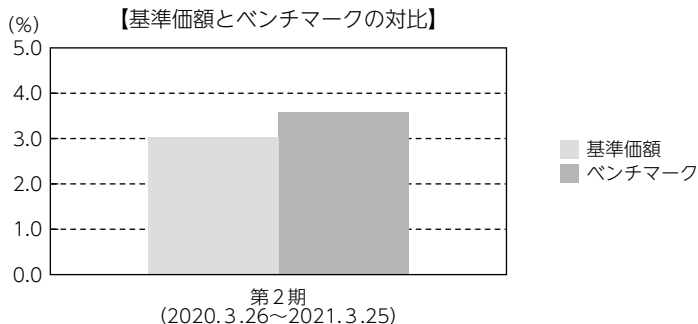
(注3) 上位11位以下をその他に含めて集計しています。

(注4) 発行国（地域）を表示しています。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で3.6%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.6%と、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。なお、乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なること、信託報酬等の影響が挙げられます。



(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基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年3月26日 ～2021年3月25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	834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

当ファンドの運用方針については、引き続き外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。今後もマザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第2期		項目の概要
	(2020年3月26日 ～2021年3月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	16円	0.154%	(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10,663円です。
(投信会社)	(7)	(0.066)	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)	(7)	(0.066)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	2	0.017	(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)	(0.011)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	18	0.170	

(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。

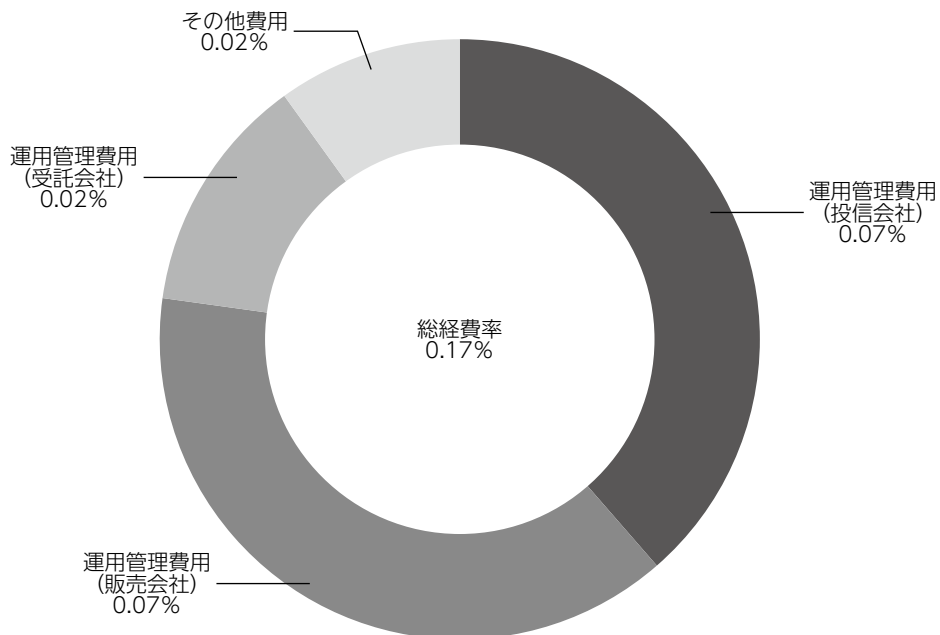
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.17%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3月26日から2021年3月25日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 303,545	千円 600,683	千□ 9,292	千円 18,522

■利害関係人との取引状況等（2020年3月26日から2021年3月25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。

■自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高 (元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高 (元本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時又は当初運用時における取得

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 860	千□ 295,114	千円 591,821

■投資信託財産の構成

2021年3月25日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	591,821	99.9
コール・ローン等、その他	838	0.1
投資信託財産総額	592,660	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3月25日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは139,377,651千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年3月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.88円、1カナダ・ドル=86.59円、1オーストラリア・ドル=82.69円、1シンガポール・ドル=80.90円、1イギリス・ポンド=149.07円、1イスラエル・シェケル=32.87円、1デンマーク・クローネ=17.30円、1ノルウェー・クローネ=12.68円、1スウェーデン・クローナ=12.65円、1メキシコ・ペソ=5.21円、1マレーシア・リンギット=26.33円、1ポーランド・ズロチ=27.81円、1ユーロ=128.65円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年3月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	592,660,624円
コール・ローン等	838,710
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	591,821,914
(B) 負 債	810,664
未 払 解 約 金	507,470
未 払 信 託 報 酬	296,316
そ の 他 未 払 費 用	6,878
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	591,849,960
元 本	546,249,010
次 期 繰 越 損 益 金	45,600,950
(D) 受 益 権 総 口 数	546,249,010口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,835円

(注) 期首における元本額は1,599,797円、当期中における追加設定元本額は575,115,235円、同解約元本額は30,466,022円です。

■損益の状況

当期 自2020年3月26日 至2021年3月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△4円
支 払 利 息	△4
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,674,177
売 買 損 益	7,993,003
売 買 損 益	△318,826
(C) 信 託 報 酬 等	△337,352
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	7,336,821
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	45,357
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	38,218,772
(配 当 等 相 当 額)	(19,486,346)
(売 買 損 益 相 当 額)	(18,732,426)
(G) 合 計(D+E+F)	45,600,950
次 期 繰 越 損 益 金(G)	45,600,950
追 加 信 託 差 損 益 金	38,218,772
(配 当 等 相 当 額)	(19,776,342)
(売 買 損 益 相 当 額)	(18,442,430)
分 配 準 備 積 立 金	7,382,178

(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	3,987,899円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	3,348,922
(c) 収 益 調 整 金	38,218,772
(d) 分 配 準 備 積 立 金	45,357
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	45,600,950
(f) 1万口当たり当期分配対象額	834.80
(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基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2021年2月22日）

（計算期間 2020年2月22日～2021年2月22日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月10日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9	ポイント 108,792.68	% △2.7	% 97.9	% -	百万円 248,485
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注3）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

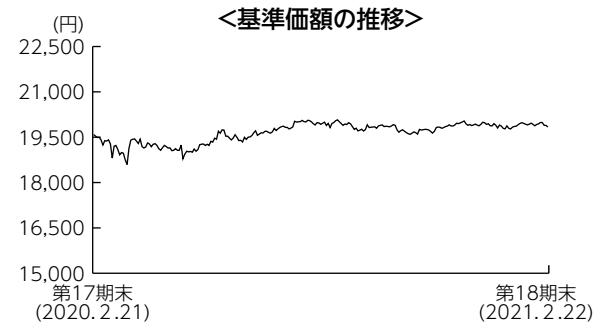
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 2 月 21 日	円 19,586	% -	ポイント 122,662.63	% -	% 97.8	% -
2 月 末	19,413	△0.9	121,401.29	△1.0	97.3	-
3 月 末	19,435	△0.8	121,796.59	△0.7	97.4	-
4 月 末	19,066	△2.7	119,329.72	△2.7	96.1	-
5 月 末	19,338	△1.3	120,973.12	△1.4	97.3	-
6 月 末	19,646	0.3	123,063.01	0.3	98.4	-
7 月 末	19,841	1.3	123,870.50	1.0	99.0	-
8 月 末	19,819	1.2	124,064.52	1.1	99.4	-
9 月 末	19,912	1.7	124,690.18	1.7	97.8	-
10 月 末	19,615	0.1	122,727.67	0.1	98.2	-
11 月 末	19,817	1.2	124,001.42	1.1	99.1	-
12 月 末	19,982	2.0	125,045.38	1.9	98.6	-
2021 年 1 月 末	19,954	1.9	125,100.34	2.0	98.6	-
(期 末) 2021 年 2 月 22 日	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-

(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2月22日から2021年2月22日まで）

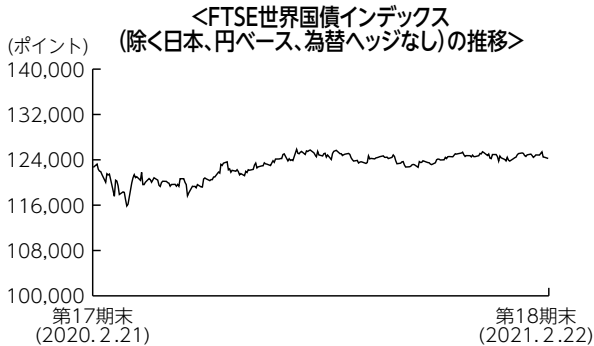


基準価額の推移

当期末の基準価額は19,836円となり、前期末比で1.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは低下（価格は上昇）しました。新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R B（米連邦準備理事会）が緊急利下げを行ったことや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。これらを主因に基準価額は上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債の利回りは低下しました。一方、ドイツ債の利回りは上昇（価格は低下）しました。米国債利回りは新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R Bが緊急利下げを行ったことや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。期末には新型コロナウイルスのワクチン期待を受けて利回りが上昇し始め、ドイツ債についても期待を受けて利回りは上昇しました。

為替市場ではドル／円は円高ドル安に、ユーロ／円は円安ユーロ高となりました。ドル／円は、F R Bによる緊急利下げや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続示唆、追加緩和期待から円高ドル安が進みました。ユーロ／円は、E C B（欧州中央銀行）の追加金融緩和策が域内景気を下支えるとの見方やユーロ圏経済指標の改善などから円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

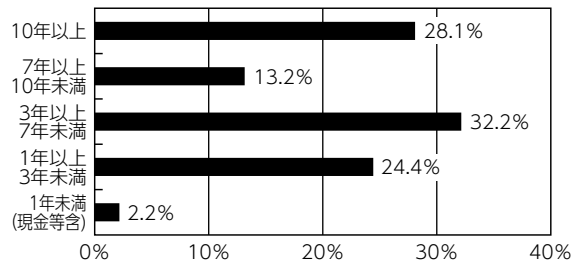
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

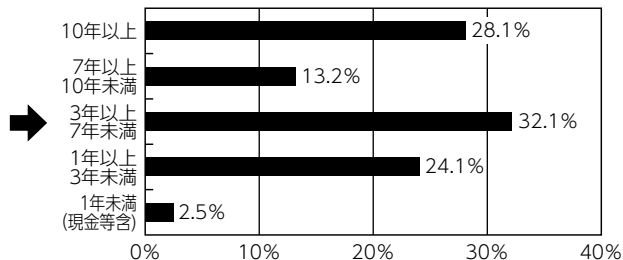
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	48.3%	48.8%	△0.5%
カナダ	1.8%	1.9%	△0.1%
計	50.1%	50.7%	△0.6%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.9%	△0.1%
計	0.7%	0.9%	△0.1%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	0.0%
ベルギー	2.3%	2.4%	△0.1%
フィンランド	0.5%	0.6%	△0.1%
フランス	9.5%	9.8%	△0.3%
ドイツ	5.7%	6.2%	△0.5%
アイルランド	0.7%	0.7%	0.0%
イタリア	8.9%	8.8%	0.1%
オランダ	1.8%	1.8%	0.0%
スペイン	5.3%	5.5%	△0.2%
ユーロ計	36.1%	37.2%	△1.1%
デンマーク	0.4%	0.5%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.3%	△0.1%
英国	6.2%	6.4%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.6%	△0.1%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.1%
計	43.7%	45.4%	△1.8%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.8%	1.9%	0.0%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.5%	0.1%
計	2.8%	2.8%	0.0%
アフリカ			
南アフリカ	0.5%	0.5%	0.0%
計	0.5%	0.5%	0.0%
現金など	1.6%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	42.4%	43.3%	△0.9%
カナダ	2.0%	2.0%	0.0%
計	44.3%	45.2%	△0.9%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.8%	0.0%
計	0.8%	0.8%	0.0%
欧州			
オーストリア	1.5%	1.6%	△0.1%
ベルギー	2.5%	2.6%	△0.1%
フィンランド	0.6%	0.7%	0.0%
フランス	10.6%	10.7%	△0.2%
ドイツ	7.5%	7.7%	△0.2%
アイルランド	0.8%	0.9%	0.0%
イタリア	9.5%	9.8%	△0.3%
オランダ	1.8%	1.9%	△0.1%
スペイン	6.1%	6.1%	0.0%
ユーロ計	40.9%	41.9%	△1.0%
デンマーク	0.5%	0.5%	0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	0.0%
英国	6.6%	6.6%	0.0%
ポーランド	0.6%	0.7%	0.0%
ノルウェー	0.2%	0.3%	0.0%
計	49.2%	50.3%	△1.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	2.8%	2.3%	0.5%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
計	3.6%	3.2%	0.4%
中近東			
イスラエル	0.4%	0.4%	0.0%
計	0.4%	0.4%	0.0%
現金など	1.6%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

(注) 世界国債インデックスとはF T S E世界国債インデックス（除く日本）です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.3%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動することをめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) その他費用	2円	0.012%
（保管費用）	(2)	(0.011)
（その他）	(0)	(0.001)
合 計	2	0.012

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（19,648円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については6ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2020年2月22日から2021年2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 204,013	千アメリカ・ドル 220,431	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 12,919	千カナダ・ドル 8,752	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 19,582	千オーストラリア・ドル 4,973	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,694	千シンガポール・ドル 844	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 22,124	千イギリス・ポンド 14,602	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 19,040	千イスラエル・シケル 567	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 9,664	千デンマーク・クローネ 5,334	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 6,951	千ノルウェー・クローネ 3,221	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 15,553	千スウェーデン・クローナ 3,970	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 64,559	千メキシコ・ペソ 27,641	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 5,060	千マレーシア・リンギット 10,671	
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド -	千南アフリカ・ランド 85,263	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 10,959	千ポーランド・ズロチ 5,220	
国	ユ ー ロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 3,473	千ユーロ 1,628
		オランダ	国債証券	6,076	5,390
		ベルギー	国債証券	8,408	6,178
		フランス	国債証券	36,111	22,676
		ドイツ	国債証券	43,157	22,151
		スペイン	国債証券	22,043	12,904
		イタリア	国債証券	32,711	28,279
		フィンランド	国債証券	1,694	439
オーストリア	国債証券	5,421	3,790		

(注) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等 (2020年2月22日から2021年2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 519,140	千アメリカ・ドル 550,714	千円 58,100,386	% 42.4	% -	% 18.2	% 17.4	% 6.7
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 29,460	千カナダ・ドル 31,957	千円 2,675,453	2.0	-	0.9	0.7	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 41,700	千オーストラリア・ドル 45,344	千円 3,772,248	2.8	-	1.9	0.7	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 6,200	千シンガポール・ドル 6,929	千円 552,643	0.4	-	0.3	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 49,770	千イギリス・ポンド 61,565	千円 9,110,469	6.6	-	5.0	1.1	0.5
イスラエル	千イスラエル・シケル 15,670	千イスラエル・シケル 17,913	千円 577,359	0.4	-	0.2	0.2	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 30,780	千デンマーク・クローネ 38,545	千円 662,988	0.5	-	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 23,270	千ノルウェー・クローネ 24,312	千円 303,668	0.2	-	0.1	0.1	-
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 30,610	千スウェーデン・クローナ 33,818	千円 431,523	0.3	-	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 180,572	千メキシコ・ペソ 203,320	千円 1,047,101	0.8	-	0.5	0.3	0.0
マレーシア	千マレーシア・リンギット 21,930	千マレーシア・リンギット 23,693	千円 618,878	0.5	-	0.3	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 28,350	千ポーランド・ズロチ 30,882	千円 881,086	0.6	-	0.3	0.2	0.2
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	7,940	9,015	1,153,117	0.8	-	0.6	0.2	0.1
オランダ	16,600	19,801	2,532,858	1.8	-	1.2	0.5	0.1
ベルギー	21,530	26,470	3,385,814	2.5	-	1.9	0.4	0.2
フランス	95,020	113,104	14,467,133	10.6	-	7.1	2.7	0.7
ドイツ	68,530	80,607	10,310,448	7.5	-	4.5	2.4	0.6
スペイン	54,310	64,919	8,303,795	6.1	-	4.0	1.4	0.6
イタリア	85,840	102,183	13,070,282	9.5	-	6.1	2.6	0.8
フィンランド	5,900	6,530	835,308	0.6	-	0.4	0.2	0.0
オーストリア	13,180	15,826	2,024,348	1.5	-	1.0	0.4	0.1
合 計	-	-	千円 134,816,915	98.4	-	54.9	32.0	11.4

(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	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		末 償還年月日
					額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.625 01/31/26		国債証券	2.6250	2,180	2,396	252,827	2026/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24		国債証券	2.2500	350	371	39,146	2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23		国債証券	1.7500	4,980	5,138	542,095	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24		国債証券	2.5000	3,890	4,151	438,000	2024/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24		国債証券	0.1250	7,000	6,983	736,769	2024/01/15
US T N/B 1.5 01/31/27		国債証券	1.5000	2,490	2,592	273,551	2027/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25		国債証券	1.3750	3,280	3,407	359,530	2025/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26		国債証券	6.0000	840	1,063	112,235	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42		国債証券	3.1250	680	818	86,326	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43		国債証券	3.1250	1,440	1,731	182,671	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46		国債証券	2.5000	1,970	2,127	224,478	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39		国債証券	3.5000	900	1,135	119,785	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29		国債証券	5.2500	490	646	68,201	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31		国債証券	5.3750	700	970	102,339	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36		国債証券	4.5000	730	1,009	106,521	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41		国債証券	4.7500	1,200	1,775	187,338	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44		国債証券	3.6250	1,630	2,113	222,976	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49		国債証券	3.0000	3,070	3,655	385,650	2049/02/15
US T N/B 2.0 02/15/22		国債証券	2.0000	8,470	8,630	910,479	2022/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38		国債証券	4.3750	550	763	80,586	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40		国債証券	4.6250	750	1,086	114,619	2040/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26		国債証券	1.6250	4,180	4,394	463,590	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45		国債証券	2.5000	2,080	2,249	237,286	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47		国債証券	3.0000	1,640	1,942	204,893	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48		国債証券	3.0000	2,540	3,013	317,963	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24		国債証券	2.7500	5,320	5,721	603,661	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25		国債証券	2.0000	5,300	5,642	595,232	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29		国債証券	2.6250	4,110	4,586	483,909	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28		国債証券	2.7500	4,370	4,900	517,043	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23		国債証券	2.0000	4,370	4,532	478,215	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27		国債証券	2.2500	3,550	3,857	406,915	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24		国債証券	2.1250	1,300	1,374	145,014	2024/02/29
US T N/B 1.5 02/28/23		国債証券	1.5000	1,000	1,027	108,434	2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/26		国債証券	2.5000	2,550	2,789	294,267	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25		国債証券	2.7500	1,660	1,816	191,616	2025/02/28
US T N/B 1.875 02/28/22		国債証券	1.8750	1,680	1,710	180,494	2022/02/28
US T N/B 2.625 02/28/23		国債証券	2.6250	1,800	1,890	199,484	2023/02/28
US T N/B 2.0 02/15/50		国債証券	2.0000	3,270	3,176	335,147	2050/02/15
US T N/B 1.375 02/15/23		国債証券	1.3750	4,000	4,099	432,533	2023/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27		国債証券	1.1250	1,100	1,120	118,248	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30		国債証券	1.5000	3,970	4,059	428,226	2030/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25		国債証券	1.1250	1,000	1,029	108,566	2025/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24		国債証券	2.1250	4,080	4,318	455,627	2024/03/31
US T N/B 1.75 03/31/22		国債証券	1.7500	6,990	7,118	751,041	2022/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23		国債証券	1.5000	2,000	2,057	217,099	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25		国債証券	2.6250	2,150	2,343	247,221	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26		国債証券	2.2500	3,090	3,342	352,660	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23		国債証券	2.5000	3,020	3,171	334,565	2023/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27		国債証券	0.6250	1,800	1,779	187,711	2027/03/31

銘柄	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 0.375 03/31/22	国債証券	0.3750	1,500	1,504	158,756	2022/03/31	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	800	802	84,693	2025/03/31	
US T N/B 0.5 03/15/23	国債証券	0.5000	2,000	2,015	212,648	2023/03/15	
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	3,000	3,097	326,786	2023/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,760	1,917	202,260	2026/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	2,490	2,632	277,697	2023/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,510	370,317	2024/04/30	
US T N/B 0.125 04/30/22	国債証券	0.1250	1,000	1,000	105,555	2022/04/30	
US T N/B 0.25 04/15/23	国債証券	0.2500	2,000	2,005	211,560	2023/04/15	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,000	1,959	206,730	2027/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,000	1,995	210,480	2025/04/30	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	710	1,024	108,108	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,200	1,690	178,367	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,040	1,474	155,562	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	980	1,155	121,870	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	810	1,118	117,974	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,200	2,544	268,492	2043/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	2,030	2,537	267,656	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,630	1,921	202,703	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,290	1,528	161,261	2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,810	1,954	206,164	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,660	3,227	340,548	2048/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	5,400	5,510	581,361	2022/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	2,100	1,818	191,900	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,090	3,597	379,554	2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	540	761	80,300	2038/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	2,620	2,714	286,343	2023/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	4,240	4,548	479,820	2024/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	5,150	5,516	582,036	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,430	5,011	528,743	2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	2,810	3,081	325,127	2029/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	3,100	3,392	357,915	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	500	735	77,554	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	3,090	3,246	342,523	2026/05/15	
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	2,900	2,997	316,228	2023/05/31	
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	4,770	5,040	531,777	2024/05/31	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	4,180	3,361	354,635	2050/05/15	
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,050	2,206	232,782	2026/05/31	
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,463	365,414	2023/05/31	
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	2,530	2,789	294,315	2025/05/31	
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,500	1,467	154,837	2027/05/31	
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	3,000	2,999	316,450	2023/05/15	
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	4,000	3,772	397,998	2030/05/15	
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	4,470	4,431	467,532	2025/05/31	
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	3,460	3,560	375,610	2023/06/30	
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	4,530	4,654	491,057	2022/06/30	
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	790	867	91,568	2025/06/30	
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	4,670	4,965	523,862	2026/06/30	
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	1,820	1,926	203,230	2023/06/30	
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,406	148,350	2024/06/30	
US T N/B 1.75 06/15/22	国債証券	1.7500	830	847	89,463	2022/06/15	
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	1,700	1,661	175,272	2027/06/30	

銘柄	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 0.25 06/15/23	国債証券	0.2500	2,800	2,807	296,150	2023/06/15		
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,972	313,557	2025/06/30		
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	1,860	2,056	216,926	2025/07/31		
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,370	2,520	265,877	2026/07/31		
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	3,690	3,875	408,881	2024/07/31		
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,477	366,869	2023/07/31		
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	1,600	1,599	168,727	2023/07/15		
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	2,000	1,936	204,257	2027/07/31		
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	1,000	989	104,403	2025/07/31		
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,151	121,518	2023/08/15		
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	710	930	98,172	2041/08/15		
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	650	860	90,749	2028/08/15		
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,110	1,473	155,401	2040/08/15		
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,430	1,621	171,019	2042/08/15		
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	1,750	2,104	222,011	2044/08/15		
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	790	1,124	118,603	2039/08/15		
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,670	2,163	228,297	2043/08/15		
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,890	2,183	230,394	2045/08/15		
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	5,180	5,532	583,676	2025/08/15		
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	1,880	2,130	224,744	2047/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	2,400	2,464	259,984	2049/08/15		
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	4,330	4,581	483,367	2023/08/15		
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	3,920	4,203	443,510	2024/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,370	2,440	257,496	2046/08/15		
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,210	3,812	402,258	2048/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,690	2,923	308,449	2027/08/15		
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,090	3,225	340,282	2026/08/15		
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	3,680	4,168	439,803	2028/08/15		
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	3,980	4,069	429,353	2022/08/15		
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,640	1,804	190,403	2025/08/31		
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	2,380	2,466	260,250	2029/08/15		
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	3,680	3,779	398,704	2022/08/31		
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	3,120	3,293	347,418	2024/08/31		
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	2,170	2,311	243,869	2023/08/31		
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	1,210	1,235	130,312	2022/08/15		
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	4,100	3,536	373,108	2040/08/15		
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,540	3,772	397,956	2050/08/15		
US T N/B 0.125 08/31/22	国債証券	0.1250	4,000	4,001	422,148	2022/08/31		
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	6,210	5,833	615,385	2030/08/15		
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	1,139	120,247	2026/08/31		
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,440	2,521	266,027	2024/08/31		
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	1,000	988	104,296	2025/08/31		
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,998	210,859	2023/08/15		
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,410	1,569	165,571	2025/09/30		
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,930	3,121	329,279	2024/09/30		
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	1,500	1,547	163,269	2023/09/30		
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	5,250	5,388	568,500	2022/09/30		
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	840	899	94,878	2023/09/30		
US T N/B 1.5 09/15/22	国債証券	1.5000	750	766	80,852	2022/09/15		
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,998	210,810	2023/09/15		
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	1,700	1,640	173,086	2027/09/30		
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,900	1,994	210,378	2026/09/30		

銘柄	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	
(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 09/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,963	312,617	2025/09/30	
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,920	2,138	225,648	2025/10/31	
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	4,000	4,156	438,484	2023/10/31	
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	3,690	3,957	417,549	2023/10/31	
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,350	2,467	260,301	2026/10/31	
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,200	2,294	242,054	2024/10/31	
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,000	2,915	307,548	2027/10/31	
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	2,000	1,973	208,164	2025/10/31	
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	1,115	117,656	2028/11/15	
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	900	1,208	127,522	2027/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,790	2,109	222,586	2044/11/15	
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	510	709	74,894	2040/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,220	1,382	145,894	2042/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	760	913	96,410	2041/11/15	
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,360	1,794	189,270	2043/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,140	2,424	255,755	2047/11/15	
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	2,900	2,569	271,052	2050/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	1,240	1,464	154,500	2045/11/15	
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	2,020	2,336	246,475	2046/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	4,690	5,023	529,933	2024/11/15	
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	910	1,277	134,819	2039/11/15	
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	2,660	3,377	356,378	2048/11/15	
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	2,922	308,330	2049/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,190	5,609	591,776	2025/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	4,840	5,575	588,210	2028/11/15	
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	5,620	5,766	608,404	2022/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	5,520	5,907	623,261	2023/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,640	2,826	298,190	2026/11/15	
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	6,590	6,810	718,492	2022/11/30	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,555	375,063	2027/11/15	
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	2,000	2,107	222,390	2023/11/30	
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	2,300	2,073	218,764	2040/11/15	
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,020	1,070	112,898	2026/11/30	
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	1,940	2,029	214,088	2029/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	6,400	6,137	647,506	2030/11/15	
US T N/B 0.25 11/15/23	国債証券	0.2500	6,000	6,011	634,211	2023/11/15	
US T N/B 0.125 11/30/22	国債証券	0.1250	5,340	5,341	563,524	2022/11/30	
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	2,000	1,957	206,532	2027/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	2,000	2,086	220,099	2024/11/30	
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	2,590	2,567	270,875	2025/11/30	
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,272	345,226	2023/12/31	
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,515	265,433	2025/12/31	
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	3,216	339,322	2024/12/31	
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	5,520	5,726	604,107	2022/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	740	781	82,498	2026/12/31	
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	1,000	998	105,314	2023/12/15	
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,600	1,684	177,754	2024/12/31	
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	1,000	990	104,502	2025/12/31	
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	1,000	977	103,142	2027/12/31	
小計	-	-	519,140	550,714	58,100,386	-	
(カナダ)			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	560	46,922	2024/03/01	

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	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	300	301	25,209	2022/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	3,160	3,257	272,751	2023/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	720	60,283	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	800	781	65,418	2026/03/01
CANADA 1.5 05/01/22	国債証券	1.5000	920	934	78,257	2022/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	800	831	69,616	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,000	1,375	115,123	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	720	1,077	90,199	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	390	586	49,096	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,600	1,709	143,158	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	680	956	80,070	2041/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	2,240	2,313	193,723	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,244	104,185	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	720	776	65,008	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,300	1,391	116,489	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	700	708	59,340	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	670	56,143	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	1,810	1,832	153,378	2030/06/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	920	959	80,358	2023/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	1,500	1,518	127,152	2022/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	2,350	2,336	195,571	2025/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	920	1,246	104,373	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	850	1,034	86,592	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	1,280	1,347	112,782	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	452	37,894	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,100	1,031	86,351	2030/12/01
小計	—	—	29,460	31,957	2,675,453	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	870	988	82,219	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	2,720	3,045	253,353	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	1,670	2,071	172,356	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	1,980	2,143	178,346	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	2,010	2,388	198,670	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	2,510	2,800	232,976	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	2,440	2,842	236,444	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	980	1,300	108,149	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	760	957	79,630	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	1,740	1,888	157,097	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	2,050	2,263	188,323	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	740	812	67,595	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	1,390	1,350	112,351	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	620	733	61,060	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	1,640	1,650	137,336	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	530	595	49,562	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	1,000	850	70,744	2051/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	680	733	61,040	2022/07/15
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	1,680	1,664	138,499	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	1,780	2,001	166,541	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,630	1,827	151,993	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,860	2,085	173,533	2029/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	2,190	2,271	189,002	2022/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	1,600	1,523	126,716	2031/11/21

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)						
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	千オーストラリア・ドル 1,450	千オーストラリア・ドル 1,434	千円 119,342	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	1,440	1,439	119,773	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,740	1,677	139,582	2030/12/21
小 計	—	—	41,700	45,344	3,772,248	—
(シンガポール)						
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 730	千シンガポール・ドル 843	千円 67,253	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	420	513	40,914	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	210	220	17,613	2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	380	454	36,250	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	130	144	11,552	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	340	366	29,194	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	310	332	26,509	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	200	228	18,215	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	100	112	8,978	2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	700	739	58,960	2023/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	480	528	42,154	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	550	598	47,716	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	800	834	66,544	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	370	426	33,998	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	480	586	46,786	2033/09/01
小 計	—	—	6,200	6,929	552,643	—
(イギリス)						
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	千イギリス・ポンド 1,310	千イギリス・ポンド 1,842	千円 272,723	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,280	1,882	278,641	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	870	1,631	241,423	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	890	997	147,593	2049/01/22
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	250	229	33,909	2046/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	500	500	73,991	2024/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,000	976	144,542	2028/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	1,500	1,502	222,361	2023/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,200	1,191	176,244	2026/01/30
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,410	1,684	249,239	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	1,330	1,931	285,773	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	1,120	1,152	170,511	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,210	1,659	245,552	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	1,250	1,273	188,463	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	910	963	142,551	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	940	1,556	230,311	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	910	1,055	156,180	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	980	1,430	211,723	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	960	1,781	263,612	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	900	959	141,928	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	1,260	1,328	196,608	2027/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	1,920	1,934	286,259	2022/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	1,560	1,587	234,847	2023/07/22
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	750	710	105,086	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	800	755	111,850	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	920	1,403	207,743	2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	1,180	1,246	184,385	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	480	524	77,655	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	790	854	126,416	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	760	1,105	163,582	2034/09/07

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,440	1,582	234,125	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	1,530	1,571	232,601	2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	520	575	85,205	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	470	367	54,449	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	580	701	103,738	2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	880	888	131,413	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	1,050	887	131,403	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	930	1,008	149,300	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	910	929	137,602	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	1,450	1,405	207,984	2030/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	760	1,076	159,354	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	880	1,403	207,676	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,280	2,094	309,883	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,060	1,765	261,246	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,020	1,895	280,491	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	780	980	145,163	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	960	1,486	220,009	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,140	1,578	233,628	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	990	1,712	253,474	2049/12/07
小計	—	—	49,770	61,565	9,110,469	—
(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 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	1,500	2,457	79,193	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,260	1,669	53,806	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	2,610	2,830	91,218	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	2,600	2,881	92,859	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	950	947	30,529	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	2,920	3,169	102,152	2023/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	500	484	15,608	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 0.75 07/31/22	国債証券	0.7500	300	302	9,750	2022/07/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,030	2,153	69,393	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	国債証券	1.2500	1,000	1,019	32,846	2022/11/30
小計	—	—	15,670	17,913	577,359	—
(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	1,650	1,599	27,514	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	8,050	14,548	250,227	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	5,320	5,884	101,211	2025/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	2,300	2,430	41,804	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	7,130	7,536	129,636	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	2,670	2,835	48,774	2029/11/15
DENMARK 0.25 11/15/22	国債証券	0.2500	3,660	3,710	63,820	2022/11/15
小計	—	—	30,780	38,545	662,988	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	3,770	3,891	48,598	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	1,000	1,044	13,042	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	6,200	6,658	83,169	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,800	3,955	49,405	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	2,198	27,457	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	1,000	1,034	12,923	2023/05/24
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	3,730	3,757	46,934	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	1,700	1,772	22,137	2029/09/06
小計	—	—	23,270	24,312	303,668	—

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	
(スウェーデン)			%	千スウェーデン・クナ	千スウェーデン・クナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,270	4,838	61,740	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	1,540	1,613	20,589	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	6,180	6,890	87,926	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	2,200	2,155	27,505	2031/05/12	
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	3,000	3,146	40,153	2022/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	8,200	8,604	109,789	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	4,250	4,506	57,505	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	1,970	2,062	26,313	2029/11/12	
小計	—	—	30,610	33,818	431,523	—	
(メキシコ)			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	14,859	15,407	79,350	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	20,000	21,027	108,292	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	17,109	20,314	104,618	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	10,000	11,329	58,346	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	20,262	104,352	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	7,830	8,066	41,542	2022/06/09	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	10,000	11,134	57,343	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	13,643	14,895	76,713	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	9,254	10,313	53,112	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	8,125	9,596	49,422	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	8,085	10,834	55,799	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	7,000	7,917	40,776	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	22,596	26,847	138,264	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	15,372	79,167	2023/12/07	
小計	—	—	180,572	203,320	1,047,101	—	
(マレーシア)			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	858	22,423	2027/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,258	32,867	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,362	87,826	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	2,008	52,448	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,234	32,232	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,200	1,349	35,236	2037/04/07	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,133	55,725	2028/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,595	67,806	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	2,600	2,934	76,659	2048/07/06	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	600	605	15,815	2034/07/05	
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	3,000	3,067	80,122	2022/08/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,286	59,713	2043/09/30	
小計	—	—	21,930	23,693	618,878	—	
(ポーランド)			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	2,850	2,981	85,062	2023/01/25	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,968	56,166	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,010	3,373	96,231	2028/04/25	
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	1,500	1,539	43,927	2022/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,447	69,821	2024/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,080	2,277	64,976	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,662	75,948	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,280	2,511	71,645	2027/07/25	
POLAND 07/25/22	国債証券	—	1,200	1,199	34,226	2022/07/25	
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	1,720	1,876	53,528	2022/09/23	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	3,940	4,340	123,836	2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	210	236	6,758	2029/10/25	

銘柄	種別	利率	額面金額	期		償還年月日
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	600	639	18,255	2024/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,850	2,828	80,701	2030/10/25
小計	—	—	28,350	30,882	881,086	—
(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	560	746	95,441	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	210	239	30,637	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	510	572	73,204	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	800	993	127,088	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	570	623	79,736	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0.8000	370	375	48,008	2022/03/15
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	400	487	62,335	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	340	389	49,840	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	630	776	99,305	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	430	466	59,681	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	380	419	53,719	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	980	1,053	134,768	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	400	488	62,484	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	240	246	31,485	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	280	289	37,051	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	360	358	45,872	2031/10/18
IRISH 10/18/22	国債証券	0.0000	220	222	28,416	2022/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	260	266	34,040	2030/10/18
小計	—	—	7,940	9,015	1,153,117	—
(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	1,060	1,856	237,460	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	960	1,580	202,134	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	570	521	66,732	2052/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	390	422	54,100	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	850	1,204	154,070	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	950	1,556	199,028	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	780	1,027	131,440	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	590	634	81,131	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	830	846	108,247	2024/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	460	473	60,539	2027/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	2,110	2,233	285,722	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	940	992	127,004	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	980	1,019	130,462	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	820	894	114,426	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,020	1,058	135,379	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	850	923	118,071	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	700	755	96,602	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	790	828	105,927	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	950	972	124,375	2030/07/15
小計	—	—	16,600	19,801	2,532,858	—
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/22	国債証券	4.0000	420	441	56,473	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	1,240	1,760	225,203	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,060	1,827	233,799	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	820	1,031	131,896	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	530	766	98,035	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,090	1,826	233,596	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	710	811	103,806	2033/04/22

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	650	1,112	142,359	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	640	783	100,199	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	490	617	78,957	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	420	609	77,973	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	420	615	78,676	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,020	1,100	140,806	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	1,050	1,163	148,792	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	810	897	114,848	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	830	886	113,400	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	880	951	121,745	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	320	316	40,517	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,010	1,103	141,206	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	670	922	118,055	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	550	692	88,625	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,140	1,207	154,391	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	850	913	116,837	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	230	271	34,712	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	800	815	104,354	2030/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	1,190	1,284	164,250	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	530	551	70,513	2024/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	660	674	86,307	2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	500	511	65,471	2027/10/22
小計	—	—	21,530	26,470	3,385,814	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 02/25/22	国債証券	0.0000	690	694	88,821	2022/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	国債証券	0.0000	1,100	1,113	142,487	2023/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	1,500	1,535	196,426	2026/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	2,720	2,770	354,339	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	2,470	2,524	322,898	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	2,700	2,735	349,943	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,030	1,236	158,103	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	2,820	3,408	435,949	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,180	3,907	499,797	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,060	2,102	268,932	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,090	2,266	289,912	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	2,540	3,749	479,635	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	2,350	2,450	313,451	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,650	2,716	347,506	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	1,800	2,911	372,455	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,690	2,269	290,233	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	1,870	2,277	291,284	2050/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	1,380	1,387	177,469	2052/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	940	1,257	160,785	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	300	250	32,008	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	1,980	2,165	276,933	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	2,940	3,661	468,371	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	2,750	2,961	378,755	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,590	4,161	532,264	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	2,620	2,736	350,084	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	2,140	2,265	289,789	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,340	2,678	342,620	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	2,070	2,176	278,364	2026/05/25

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		
(ユーロ…フランス)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	1,650	1,794	229,560	2027/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	700	708	90,570	2040/05/25		
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	3,130	3,299	422,007	2023/05/25		
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	2,190	2,515	321,805	2036/05/25		
FRANCE OAT 05/25/22	国債証券	0.0000	2,190	2,207	282,375	2022/05/25		
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	1,990	2,477	316,939	2039/06/25		
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	2,730	3,090	395,284	2023/10/25		
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	1,800	2,358	301,617	2025/10/25		
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	2,780	3,365	430,494	2027/10/25		
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,520	2,486	318,067	2038/10/25		
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,260	3,779	483,444	2032/10/25		
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	2,030	2,128	272,281	2022/10/25		
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,680	2,915	372,985	2024/11/25		
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,220	2,380	304,526	2025/11/25		
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	3,850	4,000	511,672	2026/11/25		
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	2,340	2,524	322,868	2028/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	2,200	2,215	283,329	2030/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,450	2,483	317,675	2029/11/25		
小 計	-	-	95,020	113,104	14,467,133	-		
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	840	1,009	129,077	2024/01/04		
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,160	1,663	212,761	2028/01/04		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	710	1,141	145,960	2030/01/04		
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,240	1,974	252,550	2031/01/04		
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,790	2,971	380,038	2037/01/04		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,860	1,948	249,230	2025/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	1,810	1,913	244,799	2026/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,900	2,009	257,043	2029/02/15		
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	1,420	1,482	189,649	2023/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,430	1,534	196,261	2028/02/15		
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,500	1,611	206,122	2024/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	1,960	2,059	263,449	2027/02/15		
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	800	825	105,600	2031/02/15		
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,690	1,749	223,796	2030/02/15		
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	1,030	1,045	133,747	2023/04/14		
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,540	1,574	201,335	2024/04/05		
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,250	1,284	164,339	2025/04/11		
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,410	1,511	193,332	2024/05/15		
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	1,650	1,731	221,527	2023/05/15		
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,600	1,623	207,699	2035/05/15		
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	710	1,036	132,551	2027/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	600	837	107,173	2028/07/04		
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,140	2,046	261,708	2039/07/04		
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,100	1,859	237,901	2042/07/04		
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	1,760	2,755	352,481	2044/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,180	2,277	291,365	2040/07/04		
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	1,540	1,591	203,522	2022/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,420	2,378	304,297	2034/07/04		
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	1,750	2,801	358,330	2046/08/15		
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	1,620	2,091	267,533	2048/08/15		
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	1,770	1,903	243,435	2025/08/15		
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,300	2,461	314,801	2027/08/15		

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,680	1,737	222,237	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,440	1,521	194,610	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	4,550	4,858	621,485	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,340	1,420	181,684	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,910	1,979	253,198	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,070	1,008	129,048	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,000	2,067	264,453	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	500	518	66,381	2030/08/15
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	1,650	1,705	218,190	2022/09/04
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,130	1,158	148,192	2024/10/18
BUNDESUBL 10/07/22	国債証券	0.0000	1,400	1,415	181,074	2022/10/07
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	1,280	1,304	166,811	2023/10/13
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,300	1,339	171,294	2025/10/10
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	300	309	39,592	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,500	1,553	198,764	2027/11/15
小計	—	—	68,530	80,607	10,310,448	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	1,810	1,918	245,400	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,580	2,319	296,634	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,130	1,305	167,019	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,380	2,112	270,198	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,460	1,627	208,161	2023/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,400	1,417	181,312	2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	500	505	64,681	2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,450	1,566	200,434	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,270	1,442	184,462	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,210	1,331	170,255	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,270	1,413	180,831	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,240	1,363	174,414	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,170	1,297	165,900	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	1,570	1,587	203,015	2022/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,150	1,178	150,752	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	600	584	74,788	2031/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	990	1,000	127,947	2023/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,170	1,559	199,413	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,170	2,018	258,214	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,270	2,167	277,244	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	960	1,568	200,686	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,370	1,672	213,954	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,460	1,692	216,473	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,520	2,428	310,616	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,240	1,515	193,803	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,210	1,333	170,511	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,290	1,503	192,345	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	940	960	122,873	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,420	1,448	185,248	2023/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,200	1,266	161,987	2027/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	1,540	1,717	219,729	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,180	1,640	209,797	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	830	1,552	198,523	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,180	1,659	212,220	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	860	1,178	150,763	2048/10/31

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 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	870	827	105,834	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,380	1,537	196,709	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,480	1,627	208,133	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,550	1,680	214,917	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,480	1,535	196,390	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	480	543	69,499	2023/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	1,340	1,361	174,183	2022/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	970	1,018	130,298	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,770	1,932	247,206	2030/10/31
小計	-	-	54,310	64,919	8,303,795	-
(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	1,400	1,456	186,335	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	1,000	1,006	128,741	2024/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,280	2,008	256,884	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,660	2,373	303,632	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,390	1,554	198,774	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,080	1,099	140,671	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	300	306	39,255	2026/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,020	1,298	166,138	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,020	1,472	188,339	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,090	1,245	159,300	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	590	766	98,031	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,790	2,157	275,965	2025/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	1,700	1,793	229,406	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,630	1,994	255,091	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	2,490	2,742	350,735	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	810	1,067	136,523	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,090	1,435	183,565	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,540	1,947	249,140	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	1,070	1,098	140,476	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	920	943	120,718	2023/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,020	1,084	138,752	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	600	655	83,791	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	600	591	75,633	2037/03/01
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	980	999	127,816	2022/04/15
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	770	783	100,209	2022/04/01
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,510	1,623	207,690	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,000	1,027	131,490	2031/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	970	1,484	189,831	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,548	198,031	2023/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	810	863	110,393	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,340	1,425	182,335	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,100	1,188	152,055	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,690	1,802	230,610	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	920	1,034	132,351	2027/06/01
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,630	1,806	231,125	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,277	163,407	2024/07/01
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	900	974	124,616	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,610	2,448	313,227	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,330	2,175	278,248	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,136	273,237	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	940	1,049	134,278	2027/08/01

銘柄	種類	利率	額面金額	期 価 額		償還年月日
				評 価 額		
				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 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,330	1,611	206,138	2029/08/01
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	980	997	127,633	2022/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,170	1,214	155,341	2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	1,000	1,014	129,739	2023/08/15
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	940	1,206	154,346	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	970	1,629	208,416	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	990	1,376	176,028	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,390	1,842	235,636	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,150	1,897	242,768	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	870	1,062	135,841	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	700	726	92,956	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,600	1,908	244,090	2033/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,010	1,148	146,940	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	840	1,299	166,197	2049/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	1,150	1,252	160,192	2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,020	1,201	153,665	2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	900	925	118,388	2022/09/15
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	600	627	80,222	2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	980	1,004	128,441	2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	930	996	127,430	2023/11/01
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,190	1,487	190,250	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	1,080	1,517	194,063	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,790	2,528	323,473	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	1,750	2,464	315,192	2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	1,960	2,153	275,399	2022/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	1,040	1,101	140,904	2024/11/15
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	1,250	1,398	178,894	2025/11/15
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	970	1,063	135,971	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,350	1,437	183,865	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	1,170	1,285	164,476	2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,200	1,422	181,987	2028/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,480	1,630	208,521	2030/12/01
小計	—	—	85,840	102,183	13,070,282	—
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	280	303	38,830	2024/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	380	414	52,981	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	130	163	20,898	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	430	452	57,907	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	290	330	42,293	2034/04/15
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	340	355	45,518	2023/04/15
FINLAND 04/15/22	国債証券	0.0000	120	120	15,463	2022/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	210	209	26,765	2036/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	430	517	66,188	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	380	468	59,870	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	350	521	66,657	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	570	606	77,525	2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	300	319	40,918	2025/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	240	254	32,613	2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	300	318	40,704	2027/09/15
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	400	414	53,013	2022/09/15
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	230	233	29,925	2023/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	170	169	21,636	2040/09/15

銘柄	柄	当期				期末	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.0 09/15/30		国債証券	0.0000	170	172	22,059	2030/09/15
FINLAND 0.0 09/15/24		国債証券	0.0000	180	184	23,536	2024/09/15
小計		—	—	5,900	6,530	835,308	—
(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	210	457	58,552	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47		国債証券	1.5000	520	659	84,407	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29		国債証券	0.5000	340	361	46,200	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28		国債証券	0.7500	820	884	113,179	2028/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30		国債証券	0.0000	840	853	109,145	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26		国債証券	4.8500	590	753	96,360	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37		国債証券	4.1500	890	1,456	186,298	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51		国債証券	0.7500	180	193	24,758	2051/03/20
AUSTRIA 3.65 04/20/22		国債証券	3.6500	280	293	37,587	2022/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27		国債証券	0.5000	520	550	70,465	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/23		国債証券	0.0000	200	202	25,932	2023/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34		国債証券	2.4000	480	629	80,544	2034/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20		国債証券	0.8500	170	171	21,910	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44		国債証券	3.1500	470	770	98,504	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27		国債証券	6.2500	670	959	122,698	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23		国債証券	0.0000	650	659	84,363	2023/07/15
AUSTRIA 07/15/24		国債証券	0.0000	800	816	104,386	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17		国債証券	2.1000	380	684	87,492	2117/09/20
AUSTRIA 09/20/22		国債証券	0.0000	470	474	60,729	2022/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24		国債証券	1.6500	540	584	74,825	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26		国債証券	0.7500	680	727	93,079	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25		国債証券	1.2000	640	692	88,612	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23		国債証券	1.7500	750	797	102,015	2023/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40		国債証券	0.0000	200	188	24,080	2040/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86		国債証券	1.5000	150	209	26,841	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22		国債証券	3.4000	740	792	101,373	2022/11/22
小計		—	—	13,180	15,826	2,024,348	—
合計		—	—	—	—	134,816,915	—

■投資信託財産の構成

2021年2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	134,816,915		97.7
投資信託財産総額	3,110,505		2.3
	137,927,421		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、136,245,185千円、98.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.50円、1カナダ・ドル=83.72円、1オーストラリア・ドル=83.19円、1シンガポール・ドル=79.75円、1イギリス・ポンド=147.98円、1イスラエル・シケル=32.23円、1デンマーク・クローネ=17.20円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローナ=12.76円、1メキシコ・ペソ=5.15円、1マレーシア・リンギット=26.12円、1ポーランド・ズロチ=28.53円、1ユーロ=127.91円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	139,026,864,416円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,966,445,647
公 社 債(評価額)	134,816,915,952
未 収 入 金	1,420,260,588
未 収 入 息	784,425,849
前 払 用 費	38,816,380
(B) 負 債	1,989,330,062
未 払 金	1,924,681,062
未 払 解 約 金	64,649,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	137,037,534,354
元 本	69,085,269,493
次 期 繰 越 損 益 金	67,952,264,861
(D) 受 益 権 総 口 数	69,085,269,493口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	19,836円

(注1) 期首元本額 66,784,593,799円
 追加設定元本額 22,324,176,727円
 一部解約元本額 20,023,501,033円

(注2) 期末における元本の内訳

D I AM外国債券パッシブ・ファンド	7,285,630,090円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	6,005,013円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	17,901,375円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	16,109,682円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	58,667,541円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	49,579,939円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,987,271円
たわらノーロード 先進国債券	9,989,838,812円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	186,647,242円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	971,663,519円
たわらノーロード バランス (堅実型)	26,728,812円
たわらノーロード バランス (標準型)	121,338,758円
たわらノーロード バランス (積極型)	25,135,439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)	4,073,309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)	220,889,452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)	214,665,752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)	46,211,416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)	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	275,405円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,559,857円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	3,960,740円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,185,878円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	1,140,370円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,996,521,601円
One D C 先進国債券インデックスファンド	286,853,098円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	632,089,833円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,830,048,277円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,993,683,959円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	361,021,755円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	767,057,750円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	628,680,822円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	16,652,719円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	516,637,062円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	28,446,399円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	125,346,778円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	95,961,436円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	160,485,652円

グループコントロール	2,047,605,074円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	112,880,979円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	216,614,702円
D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	7,184,218円
D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	13,602,076円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	109,987,588円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	157,862,427円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,708,262円
D I AMパッシブ資産分散ファンド	1,153,273,300円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	288,411,930円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	353,533,881円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	161,736,477円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	179,290,591円
D I AM海替フルハッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	6,015,406,638円
D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	3,819,894,345円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,325,976,349円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,699,054,337円
D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	61,358,370円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	471,072,165円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	503,573,522円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	298,873,925円
D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	27,070,483円
D I AM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	51,781,571円
D I AM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	12,259,425円
D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,487,646円
D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	41,773,382円
D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	62,816,454円
D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,343,965,366円
D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,733,964,005円
D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,001,729,443円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	553,039,600円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	192,002,729円
D I AMアクサグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,181,197,557円
D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家向け)	541,945,752円
D I AM世界アセット/バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,548,316円
D I AM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	456,033,204円
D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	467,152,429円
D I AM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	632,499,155円
D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	66,775,811円
期末元本合計	69,085,269,493円

■損益の状況

当期 自2020年2月22日 至2021年2月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,666,161,128円	
	受取利息	2,666,403,831	
	支払利息	△242,703	
(B)	有価証券売買損益	△1,147,059,846	
	売却益	6,089,848,393	
	売却損	△7,236,908,239	
(C)	その他の費用	△15,375,562	
(D)	当期損益金(A+B+C)	1,503,725,720	
(E)	前期繰越損益金	64,019,323,522	
(F)	解約差損益金	△19,145,002,454	
(G)	追加信託差損益金	21,574,218,073	
(H)	計(D+E+F+G)	67,952,264,861	
	次期繰越損益金(H)	67,952,264,861	

(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。