

運用報告書 (全体版)

DIAMエマージング債券ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投資／海外／債券
信託期間	2008年3月28日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	投資信託証券を主要投資対象とします。
運用方法	<p>外国籍投資信託である「ビムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド」(J P Y) 受益証券および国内籍投資信託である「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、エマージング諸国(新興国)の現地通貨建てソブリン債券等に実質的な投資を行います。</p> <p>外国籍投資信託への投資比率は、通常の状態においては90%以上をめどとします。投資対象ファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>実質的な組入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。</p>
組入制限	<p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への直接投資は行いません。</p>
分配方針	<p>決算日(原則として毎月12日。休業日の場合は翌営業日。)に、経費控除後の利子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。毎月の決算時には、原則として利子配当等収益を中心に分配を行います。加えて、四半期(2月、5月、8月、11月)毎に売買益(評価益を含みます。)等から分配を行います。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。</p>

愛称：ライジングネクスト

第166期	<決算日	2022年2月14日>
第167期	<決算日	2022年3月14日>
第168期	<決算日	2022年4月12日>
第169期	<決算日	2022年5月12日>
第170期	<決算日	2022年6月13日>
第171期	<決算日	2022年7月12日>

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、「DIAMエマージング債券ファンド」は、2022年7月12日に第171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/>

DIAMエマージング債券ファンド

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			JPMorgan Global E-M グローバル・ディバースファイド (円ベース、為替ヘッジなし)		投資信託 受益証券 組入比率	債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
		(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率				
第25作成期	142期(2020年2月12日)	円 3,700	円 25	% △0.6	ポイント 288.01	% △0.8	% 96.2	% 1.2	% -	百万円 1,078
	143期(2020年3月12日)	3,281	25	△10.6	258.12	△10.4	95.6	1.3	-	953
	144期(2020年4月13日)	3,127	25	△3.9	247.95	△3.9	96.0	1.4	-	897
	145期(2020年5月12日)	3,188	15	2.4	250.67	1.1	95.0	1.4	-	906
	146期(2020年6月12日)	3,366	15	6.1	267.45	6.7	95.7	1.3	-	945
	147期(2020年7月13日)	3,338	15	△0.4	266.49	△0.4	95.6	1.3	-	931
第26作成期	148期(2020年8月12日)	3,342	15	0.6	267.72	0.5	95.4	1.3	-	927
	149期(2020年9月14日)	3,343	15	0.5	268.92	0.4	94.9	1.3	-	925
	150期(2020年10月12日)	3,293	15	△1.0	266.52	△0.9	94.3	1.3	-	908
	151期(2020年11月12日)	3,377	15	3.0	274.18	2.9	95.8	1.3	-	909
	152期(2020年12月14日)	3,435	15	2.2	279.70	2.0	95.7	1.4	-	896
第27作成期	153期(2021年1月12日)	3,410	15	△0.3	278.65	△0.4	95.7	1.4	-	863
	154期(2021年2月12日)	3,457	15	1.8	284.35	2.0	95.5	1.4	-	852
	155期(2021年3月12日)	3,440	15	△0.1	281.57	△1.0	95.9	1.5	-	830
	156期(2021年4月12日)	3,409	15	△0.5	281.40	△0.1	95.6	1.5	-	816
	157期(2021年5月12日)	3,449	15	1.6	286.12	1.7	95.7	1.5	-	814
	158期(2021年6月14日)	3,529	15	2.8	293.99	2.8	96.1	1.5	-	831
第28作成期	159期(2021年7月12日)	3,417	15	△2.7	286.42	△2.6	95.5	1.6	-	798
	160期(2021年8月12日)	3,383	15	△0.6	285.54	△0.3	95.6	1.6	-	788
	161期(2021年9月13日)	3,390	15	0.7	288.02	0.9	96.4	1.6	-	784
	162期(2021年10月12日)	3,360	15	△0.4	286.52	△0.5	96.0	1.6	-	772
	163期(2021年11月12日)	3,359	15	0.4	287.98	0.5	95.8	1.6	-	756
	164期(2021年12月13日)	3,271	15	△2.2	279.99	△2.8	96.1	1.7	-	733
第29作成期	165期(2022年1月12日)	3,308	15	1.6	284.99	1.8	95.7	1.7	-	735
	166期(2022年2月14日)	3,386	15	2.8	291.26	2.2	95.7	1.6	-	745
	167期(2022年3月14日)	3,120	15	△7.4	265.54	△8.8	96.1	1.8	-	681
	168期(2022年4月12日)	3,371	15	8.5	285.63	7.6	96.1	1.8	-	739
	169期(2022年5月12日)	3,250	15	△3.1	277.40	△2.9	95.8	1.7	-	704
170期(2022年6月13日)	3,387	15	4.7	290.60	4.8	95.4	1.6	-	730	
171期(2022年7月12日)	3,279	15	△2.7	283.47	△2.5	95.3	1.7	-	707	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(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。

(注4) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

(注5) JPMorgan Global E-Mグローバル・ディバースファイドに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します(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)。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基準価額		JPMorgan Global Emerging Markets Global Dividend Fund (円ベース、為替ヘッジなし)		投資信託 組入比率	債券組入 比率	債券先物 比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率	(参考指数)			
第166期	(期首) 2022年1月12日	円 3,308	% -	ポイント 284.99	% -	% 95.7	% 1.7	% -
	1月 末	3,282	△0.8	283.12	△0.7	95.4	1.7	-
	(期末) 2022年2月14日	3,401	2.8	291.26	2.2	95.7	1.6	-
第167期	(期首) 2022年2月14日	3,386	-	291.26	-	95.7	1.6	-
	2月 末	3,301	△2.5	285.04	△2.1	96.1	1.7	-
	(期末) 2022年3月14日	3,135	△7.4	265.54	△8.8	96.1	1.8	-
第168期	(期首) 2022年3月14日	3,120	-	265.54	-	96.1	1.8	-
	3月 末	3,336	6.9	283.81	6.9	96.2	1.7	-
	(期末) 2022年4月12日	3,386	8.5	285.63	7.6	96.1	1.8	-
第169期	(期首) 2022年4月12日	3,371	-	285.63	-	96.1	1.8	-
	4月 末	3,285	△2.6	279.50	△2.1	95.8	1.7	-
	(期末) 2022年5月12日	3,265	△3.1	277.40	△2.9	95.8	1.7	-
第170期	(期首) 2022年5月12日	3,250	-	277.40	-	95.8	1.7	-
	5月 末	3,304	1.7	284.25	2.5	96.3	1.5	-
	(期末) 2022年6月13日	3,402	4.7	290.60	4.8	95.4	1.6	-
第171期	(期首) 2022年6月13日	3,387	-	290.60	-	95.4	1.6	-
	6月 末	3,367	△0.6	290.59	△0.0	95.5	1.6	-
	(期末) 2022年7月12日	3,294	△2.7	283.47	△2.5	95.3	1.7	-

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

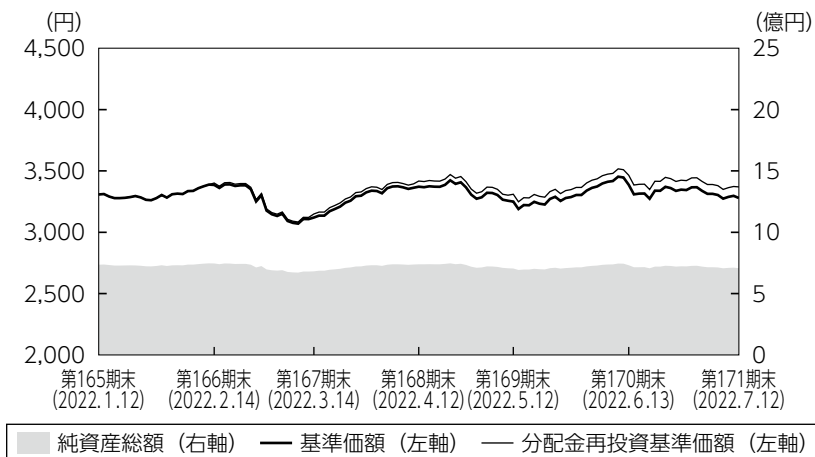
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

■第166期～第171期の運用経過（2022年1月13日から2022年7月12日まで）

基準価額等の推移



第166期首： 3,308円
 第171期末： 3,279円
 (既払分配金90円)
 騰落率： 1.9%
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

新興国債券市場が下落したものの、新興国通貨が対円で上昇したことから、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
ピムコケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド J (JPY)	2.9%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△2.7%

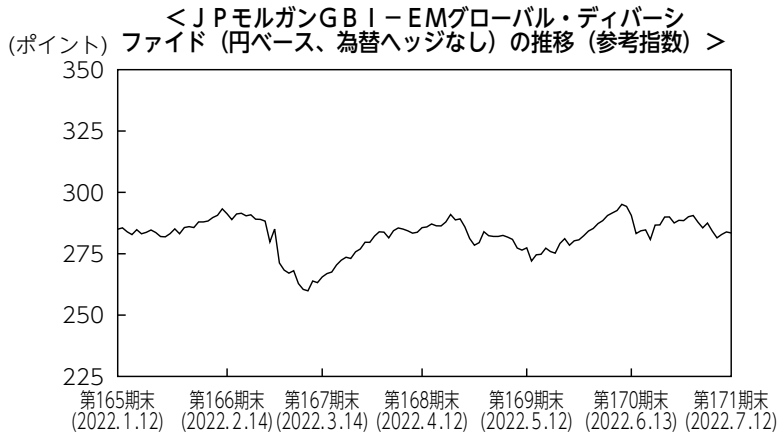
(注) ピムコケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド J (JPY) の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

投資環境

新興国債券市場（現地通貨ベース）は下落しました。一部の資源輸出国については資源価格の上昇による貿易収支の改善などがプラス要因となったものの、新興国でも継続的な利上げが実施されたことなどがマイナス要因となり、期間を通じて見ると下落しました。国別では、トルコは、エルドアン大統領が利下げを主張する中、一段の金利低下余地が意識され上昇しました。一方、ロシアはウクライナへの侵攻に伴い欧米から経済制裁が課されたことなどを受け、大幅に下落しました。

国内債券市場は下落しました。作成期初は、欧米中央銀行の金融政策引き締め観測などをを受けて利回りは上昇（価格は下落）しました。2022年2月はウクライナ情勢の深刻化への懸念などから利回りは下落（価格は上昇）したものの、3月は欧米中央銀行の金融正常化のペースが加速するとの見方が強まり利回りは上昇しました。4月から作成期末にかけて、日銀が長期国債を固定利回りで無制限に買い入れる指値オペ（公開市場操作）を継続したことなどをを受けて利回りは概ね横ばいで推移しました。

新興国の為替市場は、先進国における金融引き締めを背景に資金流出懸念の高まりから対米ドルでは下落したものの、年初来で円安米ドル高が大幅に進行したことから対円では上昇しました。通貨別で見ると、インフレ抑制のため中央銀行が連続して利上げを実施したことなどを背景にブラジルレアルが上昇しました。一方で、ハンガリーフォリントは、親ロシア派のオルバン首相率いる与党の議会選挙での勝利を受け、EU（欧州連合）との関係が悪化するとの懸念などから下落しました。



ポートフォリオについて

●当ファンド

ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド J (J P Y) の組入比率を原則として高位に維持し、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドへの投資も行いました。

●ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド J (J P Y)

債券については、南アフリカを積極姿勢とする一方で、ポーランドを消極姿勢としました。通貨については、ブラジルレアル、インドネシアルピアなどを積極姿勢とした一方で、ハンガリーフォリントを消極姿勢としました。

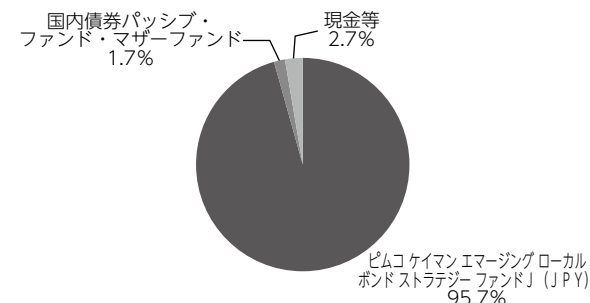
なお、当ファンドのロシア関連資産は、2022年4月に全て売却済みであり、決算日時点において保有はございません。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

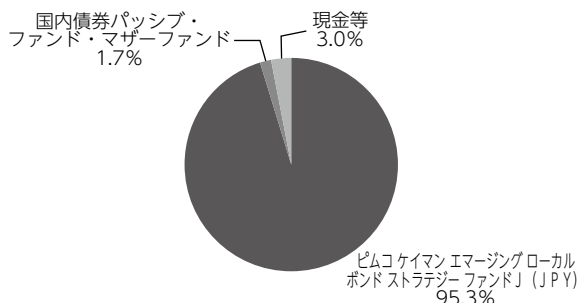
ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

ポートフォリオ構成 ※組入比率は純資産総額に対する割合です。

前作成期末

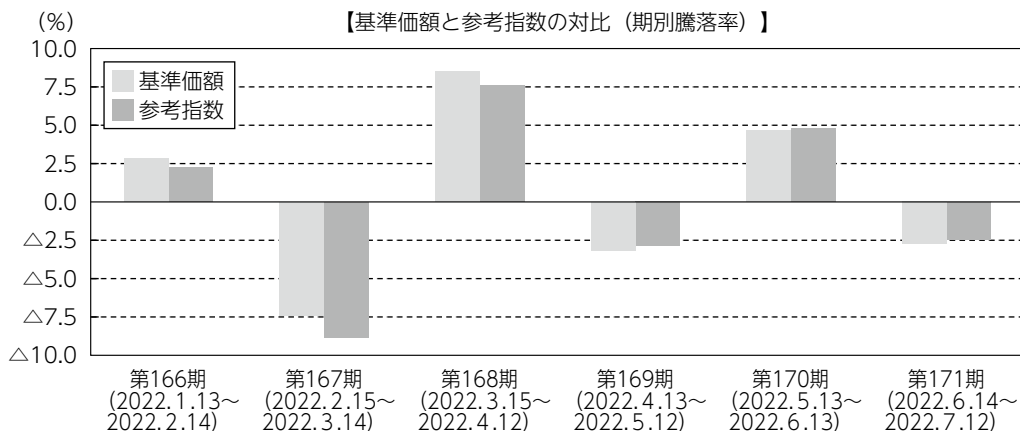


当作成期末



参考指数との差異

当ファンドはベンチマークを定めておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数であるJPモルガンGBIーEMグローバル・ディバーシファイド（円ベース、為替ヘッジなし）の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通り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	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171期
	2022年1月13日 ~2022年2月14日	2022年2月15日 ~2022年3月14日	2022年3月15日 ~2022年4月12日	2022年4月13日 ~2022年5月12日	2022年5月13日 ~2022年6月13日	2022年6月14日 ~2022年7月12日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.44%	0.48%	0.44%	0.46%	0.44%	0.46%
当期の収益	15円	15円	15円	15円	15円	15円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	2,323円	2,325円	2,330円	2,331円	2,336円	2,336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、ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド J (JPY) を高位に組入れることを基本とした運用を行います。

●ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド J (JPY)

世界的にインフレ率の上昇が継続する中、一部の資源輸出国については貿易収支の改善による恩恵を期待できる一方、多くの新興国においてインフレの加速を懸念しています。このことから、財務状況に余力がありショックへの耐性を有する国々への投資を継続します。具体的には、資源の産出による恩恵が期待でき、また中央銀行の信頼性が高い南アフリカを積極姿勢としています。通貨については、商品市況の上昇や利上げが期待されること等から投資妙味が高いと見てブラジルレアルや南アフリカランドを積極姿勢とします。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに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166期～第171期 (2022年1月13日 ～2022年7月12日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	31円	
(a) 信託報酬			(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3,300円です。
(投信会社)	(19)	(0.578)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(11)	(0.327)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(1)	(0.021)	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	0	0.000	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.000)	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
合計	31	0.926	

(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。

(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。

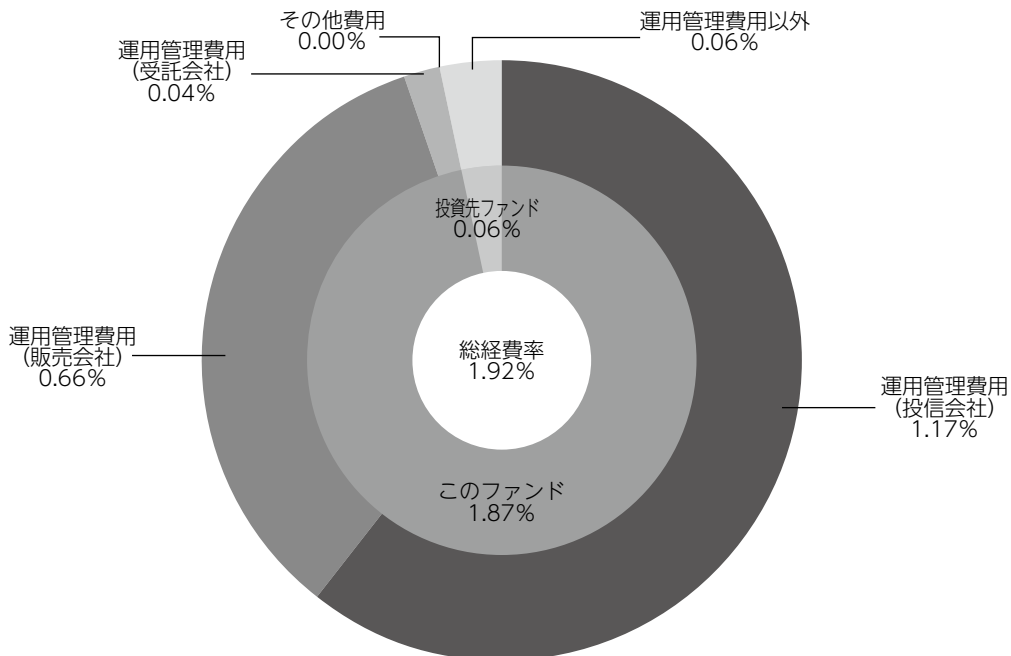
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券(マザーファンドを除く)が支払った費用を含みません。

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・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1.92%です。



総経費率 (①+②+③)	1.92%
①このファンドの費用の比率	1.87%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(注1) ①の費用は、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) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ②の費用は、このファンドまたはこのファンドの投資対象である投資信託証券から直接的に支払われません。投資顧問報酬は、委託会社が受け取った報酬の中から支払うものとします。

(注7) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8) 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。

■売買及び取引の状況（2022年1月13日から2022年7月12日まで）

投資信託受益証券

		第 166 期 ~ 第 171 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦建	ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンドJ (JPY)	千口	千円	千口	千円
		—	—	9.76918	23,000

(注) 金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年1月13日から2022年7月12日まで）

期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2022年1月13日から2022年7月12日まで）

【D I A Mエマージング債券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等はありません。

【国内債券パッシブ・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		第 166 期 ~ 第 171 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
		百万円		百万円	百万円	
公 社 債	605,716	63,742	10.5 %	522,981	64,559	12.3 %

平均保有割合 0.0%

(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、当作成期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ア ン ド 名	第 28 作 成 期 末	第 29 作 成 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
	千□	千□	千円	%
ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド J (JPY)	305.94456	296.17538	673,798	95.3
合 計	305.94456	296.17538	673,798	95.3

(注) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

	第 28 作 成 期 末	第 29 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,450	9,450	11,979

■投資信託財産の構成

2022年7月12日現在

項 目	第 29 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 673,798	% 94.7
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,979	1.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	25,975	3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	711,753	100.0

(注) 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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月14日)、(2022年3月14日)、(2022年4月12日)、(2022年5月12日)、(2022年6月13日)、(2022年7月12日)現在

項 目	第 166 期 末	第 167 期 末	第 168 期 末	第 169 期 末	第 170 期 末	第 171 期 末
(A) 資 産	751,052,902円	687,070,173円	743,436,176円	710,464,762円	735,807,858円	711,753,829円
コール・ローン等	25,001,233	19,453,509	21,080,489	23,588,557	26,595,327	25,975,063
投資信託受益証券(評価額)	713,887,617	655,431,822	710,253,060	674,776,413	697,196,844	673,798,989
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	12,164,052	12,184,842	12,102,627	12,099,792	12,015,687	11,979,777
(B) 負 債	5,069,678	5,336,418	4,383,648	5,967,950	5,079,598	4,465,853
未払収益分配金	3,305,121	3,277,100	3,288,246	3,251,465	3,236,629	3,235,838
未払解約金	523,094	1,037,614	27,583	1,596,461	669,338	163,206
未払信託報酬	1,239,533	1,020,115	1,066,154	1,118,280	1,171,805	1,065,153
その他未払費用	1,930	1,589	1,665	1,744	1,826	1,656
(C) 純資産総額(A-B)	745,983,224	681,733,755	739,052,528	704,496,812	730,728,260	707,287,976
元 本	2,203,414,113	2,184,733,716	2,192,164,445	2,167,643,523	2,157,752,686	2,157,225,568
次期繰越損益金	△1,457,430,889	△1,502,999,961	△1,453,111,917	△1,463,146,711	△1,427,024,426	△1,449,937,592
(D) 受 益 権 総 口 数	2,203,414,113口	2,184,733,716口	2,192,164,445口	2,167,643,523口	2,157,752,686口	2,157,225,568口
1万口当たり基準価額(C/D)	3,386円	3,120円	3,371円	3,250円	3,387円	3,279円

(注) 第165期末における元本額は2,223,916,487円、当作成期間(第166期～第171期)中における追加設定元本額は38,811,729円、同解約元本額は105,502,648円です。

■損益の状況

〔自 2022年1月13日 至 2022年2月14日〕〔自 2022年2月15日 至 2022年3月14日〕〔自 2022年3月15日 至 2022年4月12日〕〔自 2022年4月13日 至 2022年5月12日〕〔自 2022年5月13日 至 2022年6月13日〕〔自 2022年6月14日 至 2022年7月12日〕

項 目	第 166 期	第 167 期	第 168 期	第 169 期	第 170 期	第 171 期
(A) 配 当 等 収 益	4,541,002円	4,537,428円	4,543,005円	4,478,407円	4,482,983円	4,441,185円
受 取 配 当 金	4,541,313	4,537,576	4,543,059	4,478,694	4,483,357	4,441,845
受 取 利 息	2	7	1	-	-	60
支 払 利 息	△313	△155	△55	△287	△374	△720
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	17,115,103	△58,125,101	54,637,838	△26,384,764	29,363,956	△23,390,214
売 買 益	17,294,658	308,771	54,821,238	235,704	29,483,282	37,511
売 買 損	△179,555	△58,433,872	△183,400	△26,620,468	△119,326	△23,427,725
(C) 信 託 報 酬 等	△1,241,463	△1,021,704	△1,067,819	△1,120,024	△1,173,631	△1,066,809
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	20,414,642	△54,609,377	58,113,024	△23,026,381	32,673,308	△20,015,838
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△785,523,307	△760,206,720	△815,940,036	△750,701,669	△771,564,572	△740,385,249
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△689,017,103	△684,906,764	△691,996,659	△686,167,196	△684,896,533	△686,300,667
(配 当 等 相 当 額)	(237,797,738)	(236,386,430)	(238,833,664)	(236,841,664)	(236,407,489)	(236,913,348)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△926,814,841)	(△921,293,194)	(△930,830,323)	(△923,008,860)	(△921,304,022)	(△923,214,015)
(G) 合 計 (D+E+F)	△1,454,125,768	△1,499,722,861	△1,449,823,671	△1,459,895,246	△1,423,787,797	△1,446,701,754
(H) 収 益 分 配 金	△3,305,121	△3,277,100	△3,288,246	△3,251,465	△3,236,629	△3,235,838
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△1,457,430,889	△1,502,999,961	△1,453,111,917	△1,463,146,711	△1,427,024,426	△1,449,937,592
追 加 信 託 差 損 益 金	△689,017,103	△684,906,764	△691,996,659	△686,167,196	△684,896,533	△686,300,667
(配 当 等 相 当 額)	(237,797,742)	(236,386,431)	(238,833,676)	(236,841,664)	(236,407,490)	(236,913,350)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△926,814,845)	(△921,293,195)	(△930,830,335)	(△923,008,860)	(△921,304,023)	(△923,214,017)
分 配 準 備 積 立 金	274,266,696	271,581,964	272,046,507	268,437,376	267,663,957	267,180,235
繰 越 損 益 金	△1,042,680,482	△1,089,675,161	△1,033,161,765	△1,045,416,891	△1,009,791,850	△1,030,817,160

(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	第 166 期	第 167 期	第 168 期	第 169 期	第 170 期	第 171 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,287,499円	3,521,682円	4,467,576円	3,364,481円	4,334,007円	3,380,639円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	237,797,742	236,386,431	238,833,676	236,841,664	236,407,490	236,913,350
(d) 分 配 準 備 積 立 金	273,284,318	271,337,382	270,867,177	268,324,360	266,566,579	267,035,434
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	515,369,559	511,245,495	514,168,429	508,530,505	507,308,076	507,329,423
(f) 1万口当たり当期分配対象額	2,338.96	2,340.08	2,345.48	2,346.01	2,351.09	2,351.77
(g) 分 配 金	3,305,121	3,277,100	3,288,246	3,251,465	3,236,629	3,235,838
(h) 1万口当たり分配金	15	15	15	15	15	15

■分配金のお知らせ

決算期	第 166 期	第 167 期	第 168 期	第 169 期	第 170 期	第 171 期
1 万口当たり分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

《お知らせ》

■当ファンドが投資対象とする「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を 1 兆円から 3 兆円とする約款変更を行いました。

(2022年 3月15日)

ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド J (J P Y)

当ファンドは「D I A Mエマージング債券ファンド」が投資対象とする外国投資信託受益証券です。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ケイマン籍円建外国投資信託受益証券
投資方針および 主要投資対象	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国^(※1)の現地通貨建てソブリン債券等およびその派生商品^(※2)に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。通常、純資産総額の3分の2以上を、新興国の現地通貨建てソブリン債券等およびその派生商品に投資を行います。 ・^(※1) 新興国とは、投資顧問会社はその判断において、ファンドの戦略的目的と合致すると考える国とし、たとえば世界銀行や国際連合より新興国もしくは発展途上国として分類されている国、またはベンチマークに採用されている国などとします。 ・^(※2) 派生商品については、先渡取引、オプション取引、先物取引、スワップ取引などを活用します。 ・新興国の現地通貨建てソブリン債券の代表的指数である「J P モルガン G B I - E M グローバル・ディバーシファイド (円ベース、為替ヘッジなし)」^(注)をベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざします。 ・ムーディーズ社による格付がB格 (またはS & P社、もしくはフィッチ社による同等格の格付) 未満の格付の証券 (格付がない場合は同等の信用度を有すると投資顧問会社が判断するものを含みます。) への投資割合は、純資産総額の15%以内とします。 ・ポートフォリオの平均デュレーションは、ベンチマークの平均デュレーションに対して±2年の範囲内とします。 ・銘柄選定にあたっては、投資対象国のファンダメンタルズ分析や債券等のバリュエーション分析などを行って、投資国および投資対象銘柄を選定します。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 <p>^(注) J P モルガン G B I - E M グローバル・ディバーシファイドに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p>
運 用 会 社	ピムコ社 (PIMCO-Pacific Investment Management Company LLC)

ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンド J (J P Y) はケイマン籍外国投資信託受益証券で、2022年2月28日に会計期間が終了し、現地の公認会計士による財務諸表監査を受けて完了しています。以下は、2022年2月28日現在の財務諸表の原文の一部を抜粋・翻訳したものです。

ピムコ ケイマン エマージング ローカル
ボンド ストラテジー ファンド

損益計算書
(米ドル建表示)

2021年3月1日～2022年2月28日

(金額は千単位)

投資利益：		
受取利息（外国税控除後）*	\$	298
雑収入		0
利益合計		298
費用：		
支払利息		4
弁護士費用		0
費用合計		4
投資純利益		294
実現純損益：		
投資有価証券（外国税控除後）*		(303)
上場または集中決済金融デリバティブ商品		117
店頭金融デリバティブ商品		3
外国為替取引		(3)
実現純利益（損失）		(186)
評価損益の純変動額：		
投資有価証券（外国税控除後）*		(476)
上場または集中決済金融デリバティブ商品		(94)
店頭金融デリバティブ商品		(55)
外貨建資産・負債		(37)
評価（損失）の純変動額		(662)
純（損失）		(848)
運用による純資産の純（減）額	\$	(554)
* 外国税	\$	20

※損益計算書上のゼロは、1,000未満の実数が切捨てられていることを表す場合があります。

組入投資有価証券明細
2022年2月28日現在

		額面金額 (千単位)		評価額 (千単位)
投資有価証券 105.0%				
アルゼンチン 0.5%				
ソブリン債 0.5%				
Argentina Bocon				
34.191% due 10/04/2022	ARS	255	\$	1
Argentina Government International Bond				
0.500% due 07/09/2030	\$	47		13
1.125% due 07/09/2035		31		9
Argentina Treasury Bills				
39.231% due 04/03/2022	ARS	453		2
Argentina Treasury Bond BONCER				
1.450% due 08/13/2023 (a)		205		2
Argentine Bonos del Tesoro				
15.500% due 10/17/2026		220		1
アルゼンチン合計 (原価 \$51)				<u>28</u>
チリ4.0%				
ソブリン債 4.0%				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos				
2.300% due 10/01/2028	CLP	10,000	\$	10
4.500% due 03/01/2026		10,000		12
4.700% due 09/01/2030		25,000		29
5.000% due 10/01/2028		105,000		129
5.000% due 03/01/2035		10,000		12
6.000% due 01/01/2043		30,000		39
チリ合計 (原価 \$262)				<u>231</u>
中国 15.0%				
ソブリン債 15.0%				
China Government International Bond				
2.360% due 07/02/2023	CNY	500	\$	79
2.700% due 11/03/2026		700		112
2.740% due 08/04/2026		1,200		192
2.750% due 09/01/2023		400		64
3.010% due 05/13/2028		400		64
3.020% due 10/22/2025		100		16
3.030% due 03/11/2026		800		129
3.810% due 09/14/2050		300		51
4.080% due 08/22/2023		1,000		164
中国合計 (原価 \$803)				<u>871</u>

		額面金額 (千単位)		評価額 (千単位)
コロンビア 6.4%				
ソブリン債 6.4%				
Colombia Government International Bond				
4.375% due 03/21/2023	COP	77,000	\$	19
9.850% due 06/28/2027		141,000		38
Colombian TES				
5.750% due 11/03/2027		206,700		45
6.250% due 11/03/2027		735,300		160
6.250% due 07/09/2036		166,000		32
6.250% due 07/09/2036		34,000		7
7.000% due 03/26/2031		118,900		26
7.000% due 06/30/2032		146,500		32
7.250% due 10/26/2050		75,600		15
コロンビア合計 (原価 \$430)				<u>374</u>
チェコ共和国 3.0%				
ソブリン債 3.0%				
Czech Republic Government Bond				
0.250% due 02/10/2027	CZK	1,000	\$	39
0.950% due 05/15/2030		100		4
1.000% due 06/26/2026		1,100		44
1.200% due 03/13/2031		300		11
2.000% due 10/13/2033		1,500		60
4.200% due 12/04/2036		300		15
チェコ共和国合計 (原価 \$183)				<u>173</u>
エジプト 1.0%				
ソブリン債 1.0%				
Egypt Government International Bond				
14.605% due 09/08/2025	EGP	900	\$	57
エジプト合計 (原価 \$58)				<u>57</u>
エルサルバドル 0.2%				
ソブリン債 0.2%				
El Salvador Government International Bond				
7.750% due 01/24/2023	\$	10	\$	9
エルサルバドル合計 (原価 \$10)				<u>9</u>

		額面金額 (千単位)		評価額 (千単位)
ハンガリー 2.7%				
ソブリン債 2.7%				
Hungary Government Bond				
2.000% due 05/23/2029	HUF	13,000	\$	32
3.000% due 08/21/2030		3,800		10
3.000% due 10/27/2038		2,900		6
3.250% due 10/22/2031		4,600		12
4.000% due 04/28/2051		2,200		5
5.500% due 06/24/2025		29,500		90
ハンガリー合計				155
(原価 \$218)				
インドネシア 5.9%				
ソブリン債 5.9%				
Indonesia Government International Bond				
6.500% due 02/15/2031	IDR	646,000	\$	45
7.500% due 08/15/2032		2,218,000		164
7.500% due 06/15/2035		800,000		59
8.250% due 06/15/2032		54,000		4
8.375% due 03/15/2034		448,000		35
9.000% due 03/15/2029		101,000		8
9.500% due 07/15/2031		76,000		6
10.500% due 08/15/2030		230,000		20
インドネシア合計				341
(原価 \$341)				
イスラエル 3.8%				
ソブリン債 3.8%				
Bank of Israel Bill - Makam				
0.000% due 06/08/2022	ILS	400	\$	125
Israel Government Bond				
0.750% due 07/31/2022		300		94
イスラエル合計				219
(原価 \$213)				

		額面金額 (千単位)		評価額 (千単位)
マレーシア 9.7%				
ソブリン債 9.7%				
Malaysia Government International Bond				
2.632% due 04/15/2031	MYR	41	\$	9
3.422% due 09/30/2027		200		48
3.447% due 07/15/2036		185		41
3.465% due 10/15/2030		100		23
3.733% due 06/15/2028		300		72
3.885% due 08/15/2029		150		36
3.900% due 11/30/2026		200		49
4.065% due 06/15/2050		100		23
4.130% due 07/09/2029		170		42
4.258% due 07/26/2027		62		15
4.369% due 10/31/2028		550		137
4.582% due 08/30/2033		50		13
4.724% due 06/15/2033		220		56
マレーシア合計				<u>564</u>
(原価 \$573)				
メキシコ 4.3%				
ソブリン債 4.3%				
Mexico Government International Bond				
7.500% due 06/03/2027	MXN	700	\$	34
7.750% due 05/29/2031		600		29
7.750% due 11/13/2042		700		33
8.000% due 11/07/2047		700		33
8.500% due 05/31/2029		2,014		102
8.500% due 11/18/2038		400		20
メキシコ合計				<u>251</u>
(原価 \$276)				
ナイジェリア 0.2%				
ソブリン債 0.2%				
Nigeria Government International Bond				
5.625% due 06/27/2022	\$	12	\$	12
ナイジェリア合計				<u>12</u>
(原価 \$12)				
ペルー 5.0%				
ソブリン債 5.0%				
Peru Government International Bond				
5.940% due 02/12/2029	PEN	200	\$	53
6.350% due 08/12/2028		250		68
6.900% due 08/12/2037		100		26
6.950% due 08/12/2031		200		56
8.200% due 08/12/2026		300		89
ペルー合計				<u>292</u>
(原価 \$325)				

		額面金額 (千単位)		評価額 (千単位)
ポーランド 1.7%				
ソブリン債 1.7%				
Poland Government International Bond				
0.250% due 10/25/2026	PLN	200	\$	40
1.750% due 04/25/2032		300		58
2.750% due 04/25/2028		15		3
ポーランド合計 (原価 \$116)				<u>101</u>
ルーマニア 2.3%				
ソブリン債 2.3%				
Romania Government International Bond				
3.700% due 11/25/2024	RON	100	\$	22
4.150% due 01/26/2028		135		28
4.500% due 06/17/2024		185		42
4.750% due 10/11/2034		100		20
5.000% due 02/12/2029		100		22
ルーマニア合計 (原価 \$151)				<u>134</u>
ロシア 1.3%				
ソブリン債 1.3%				
Russia Government International Bond				
6.900% due 05/23/2029	RUB	6,510	\$	18
7.050% due 01/19/2028		5,800		16
7.250% due 05/10/2034		6,000		17
7.650% due 04/10/2030		2,600		7
8.500% due 09/17/2031		5,300		15
ロシア合計 (原価 \$317)				<u>73</u>
シンガポール 2.9%				
ソブリン債 2.9%				
Singapore Government Bond				
1.625% due 07/01/2031	SGD	200	\$	144
3.375% due 09/01/2033		31		26
シンガポール合計 (原価 \$170)				<u>170</u>

	額面金額 (千単位)	評価額 (千単位)
南アフリカ 10.1%		
ソブリン債 10.1%		
South Africa Government International Bond		
6.250% due 03/31/2036	ZAR 700	\$ 32
6.500% due 02/28/2041	300	13
7.000% due 02/28/2031	100	5
8.250% due 03/31/2032	1,510	88
8.500% due 01/31/2037 (c)	1,500	83
8.750% due 01/31/2044	900	49
8.875% due 02/28/2035	900	52
9.000% due 01/31/2040	1,300	73
10.500% due 12/21/2026 (c)	2,700	193
南アフリカ合計 (原価 \$676)		<u>588</u>
国際機関 6.5%		
ソブリン債 6.5%		
Asian Development Bank		
4.700% due 03/12/2024	MXN 200	\$ 9
International Bank for Reconstruction & Development		
4.500% due 04/15/2026	IDR 600,000	41
4.600% due 02/09/2026	1,200,000	82
International Finance Corp.		
8.000% due 10/09/2023	3,300,000	242
国際機関合計 (原価 \$375)		<u>374</u>
タイ 6.3%		
ソブリン債 6.3%		
Thailand Government Bond		
1.585% due 12/17/2035	THB 6,871	\$ 187
2.000% due 06/17/2042	1,500	39
2.875% due 06/17/2046	100	3
3.300% due 06/17/2038	1,350	44
3.775% due 06/25/2032	2,730	95
タイ合計 (原価 \$389)		<u>368</u>
トルコ 0.9%		
ソブリン債 0.9%		
Turkey Government International Bond		
10.500% due 08/11/2027	TRY 100	\$ 5
10.600% due 02/11/2026	100	5
11.000% due 02/24/2027	575	26
12.600% due 10/01/2025	300	16
トルコ合計 (原価 \$139)		<u>52</u>

	額面金額 (千単位)	評価額 (千単位)
ウガンダ 0.0%		
ソブリン債 0.0%		
Republic of Uganda Government Bond		
16.250% due 11/08/2035	UGX	7,300
ウガンダ合計		\$ 2
(原価 \$2)		<u>2</u>
ウクライナ 0.3%		
ソブリン債 0.3%		
Ukraine Government International Bond		
0.000% due 05/31/2040	\$	75
ウクライナ合計		\$ 15
(原価 \$73)		<u>15</u>
ザンビア 0.4%		
ソブリン債 0.4%		
Zambia Government International Bond		
13.000% due 01/25/2031	ZMW	700
ザンビア合計		\$ 23
(原価 \$22)		<u>23</u>
短期証券 10.6%		
定期預金 8.4%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
0.005% due 03/01/2022	\$	1
		\$ 1
BNP Paribas Bank		
(0.340%) due 03/01/2022	¥	17
0.005% due 03/01/2022	\$	50
		50
0.005% due 03/01/2022	HKD	5
		1
0.070% due 03/01/2022	SGD	1
		1
3.950% due 03/01/2022	ZAR	28
		2
Citibank N.A.		
0.005% due 03/01/2022	\$	64
		64
DBS Bank Ltd.		
0.005% due 03/01/2022		13
		13
HSBC Bank PLC		
(0.780%) due 03/01/2022	EUR	1
		1
JPMorgan Chase Bank N.A.		
0.005% due 03/01/2022	\$	15
		15
MUFG Bank Ltd.		
(0.340%) due 03/01/2022	¥	16
		0
Royal Bank of Canada		
0.005% due 03/01/2022	\$	128
		128
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.780%) due 03/01/2022	EUR	2
		3
(0.340%) due 03/01/2022	¥	11
		0
0.005% due 03/01/2022	\$	201
		201
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.340%) due 03/01/2022	¥	1
		0
0.005% due 03/01/2022	\$	10
		<u>10</u>
		<u>490</u>

	額面金額 (千単位)	評価額 (千単位)
イスラエル財務省短期証券 (b) 2.2%		
0.000% due 04/06/2022	ILS 300	\$ 94
0.010% due 11/02/2022	100	31
		125
短期証券合計 (原価 \$614)		615
投資有価証券合計 105.0% (原価 \$6,799)		\$ 6,092
金融デリバティブ商品 (d)(e) 1.2% (原価またはプレミアム、純額 \$(3))		72
その他資産・負債、純額 (6.2%)		(362)
純資産 100.0%		\$ 5,802

組入投資有価証券明細の注記 (千単位*、契約数を除く)

* 明細表上のゼロは、1,000未満の実数が切捨てられていることを表す場合があります。

(a) 有価証券の額面金額はインフレ調整済みです。

(b) クーポンは、最終利回りを示しています。

借入およびその他の資金調達取引の概要

売戻条件付買入取引

契約先	借入金利 ⁽¹⁾	決済日	満期日	借入額 ⁽¹⁾	売戻条件付買入取引に係る未払金
BRC	4.700%	01/07/2022	03/14/2022	ZAR (2,393)	\$ (156)
BRC	5.250%	02/08/2022	03/14/2022	(1,214)	(79)
売戻条件付買入取引合計					\$ (235)

担保付借入に分類される特定の取引

	契約満期日までの残日数				合計
	オーバーナイト・ ロールオーバー	30日以内	31-90日	90日超	
売戻条件付買入取引					
Non-U.S. Government Debt	\$ 0	\$ (235)	\$ 0	\$ 0	\$ (235)
売戻条件付買入取引合計	\$ 0	\$ (235)	\$ 0	\$ 0	\$ (235)
借入額合計	\$ 0	\$ (235)	\$ 0	\$ 0	\$ (235)
売戻条件付買入取引に係る未払金					\$ (235)

借入およびその他の資金調達取引の概要

以下は、2022年2月28日時点の借入およびその他の資金調達取引ならびに差入／（受入）担保の市場価格を契約先別に分類して要約したものです。

(c) 2022年2月28日時点で、以下の基本契約書の条件に基づき、市場価格で合計247米ドルの有価証券が担保として差入れられています。

契約先	買戻条件付 売却取引に係る 未収入金	売戻条件付 買入取引に係る 未払金	買戻条件付 売却取引に係る 未払金	信用取引に係る 未払金	借入および その他の資金 調達取引合計	差入／ （受入）担保	ネットエクス ポージャー ⁽²⁾
GMRA (レポ取引の基本契約書)							
BRC	\$ 0	\$ (235)	\$ 0	\$ 0	\$ (235)	\$ 247	\$ 12
借入およびその他の資金調達取引合計	\$ 0	\$ (235)	\$ 0	\$ 0			

- (1) 2022年2月28日に終了する期間の借入残高の平均は81米ドルで加重平均金利は4.175%。借入の平均は、同期間に保有されていた場合には、買戻条件付売却取引および売戻条件付買入取引を含みます。
- (2) ネットエクスポージャーは、デフォルト時に契約先から支払われる未収入金、あるいは契約先に支払う未払金の純額を表します。借入およびその他の資金調達取引からのエクスポージャーは、同一の法人との同一の基本契約書の規定に基づく取引間でのみ相殺することができます。

(d) 金融デリバティブ商品：上場または集中決済

先物契約

銘柄	種類	満期月	契約数	評価益/ （評価損）	変動証拠金	
					資産	負債
Fed Fund 30-Day January Futures	ショート	01/2023	4	\$ 5	\$ 0	\$ (3)
先物契約合計				\$ 5	\$ 0	\$ (3)

スワップ 金利スワップ

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ （評価損）	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.250%	06/17/2025	\$ 40	\$ 1	\$ 0	\$ 0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.000%	03/15/2022	ZAR 1,200	(1)	1	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.375%	01/29/2023	2,500	(2)	(2)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.020%	07/26/2023	7,500	12	12	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.250%	09/19/2023	400	(1)	(1)	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.515%	03/07/2024	500	(1)	(1)	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.750%	03/20/2024	3,100	(9)	(8)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.255%	07/09/2025	800	(1)	(1)	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.105%	12/02/2025	100	0	0	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.200%	03/08/2026	1,100	0	0	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.757%	04/14/2026	900	(1)	(1)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.700%	04/21/2026	200	0	0	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.680%	06/08/2026	600	(1)	(1)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.601%	06/09/2026	100	0	0	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.470%	07/26/2026	1,600	4	4	1	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.324%	12/21/2026	1,500	5	5	0	(1)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.067%	12/21/2026	200	0	0	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.300%	03/15/2027	1,700	(8)	(3)	0	(1)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.500%	12/19/2028	2,700	15	16	1	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.000%	06/19/2029	1,100	(4)	(4)	0	(1)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.490%	03/06/2030	100	0	0	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.120%	05/26/2030	800	(1)	0	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	2.250%	12/19/2023	CZK 1,100	(2)	(2)	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.781%	02/04/2024	2,300	(6)	(6)	0	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	0.690%	03/31/2025	600	3	3	0	0

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ (評価損)	変動証拠金		
							資産	負債	
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	0.475%	06/04/2025	CZK	1,500	\$ (7)	\$ (7)	\$ 0	\$ 0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	0.915%	09/01/2025		1,100	(5)	(5)	0	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	2.000%	09/19/2025		3,900	12	12	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.050%	12/23/2025		3,300	(16)	(16)	0	(1)
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.575%	03/26/2026		700	(2)	(2)	0	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	0.765%	04/07/2026		2,200	12	12	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.903%	08/04/2026		200	(1)	(1)	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.872%	08/05/2026		400	(1)	(1)	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	3.530%	12/27/2026		200	0	0	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	3.930%	01/18/2027		200	0	0	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	3.770%	02/11/2027		400	0	0	0	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	2.000%	06/20/2028		2,500	9	9	0	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	1.750%	06/19/2029		400	2	2	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.477%	02/04/2030		1,200	(7)	(7)	0	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	0.929%	03/13/2030		300	2	2	0	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	0.800%	05/11/2030		1,600	(13)	(6)	0	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	3.490%	01/18/2032		100	0	0	0	0
Receive(1)	6-Month EURIBOR	(0.250%)	09/21/2027	EUR	100	6	1	0	0
Pay	6-Month HUF-BUBOR	0.840%	08/18/2022	HUF	75,100	(4)	(4)	0	0
Pay	6-Month HUF-BUBOR	1.000%	09/19/2023		57,700	(13)	(3)	0	0
Receive	6-Month HUF-BUBOR	1.250%	09/19/2023		27,700	6	4	0	0
Pay	6-Month HUF-BUBOR	2.325%	07/20/2024		34,600	(7)	(7)	0	(1)
Receive	6-Month HUF-BUBOR	0.980%	07/23/2024		89,300	28	28	1	0
Receive	6-Month HUF-BUBOR	0.710%	03/31/2025		1,300	1	1	0	0
Receive	6-Month HUF-BUBOR	1.155%	04/03/2025		19,000	7	7	1	0
Pay	6-Month HUF-BUBOR	1.243%	09/08/2025		20,100	(8)	(8)	0	0
Pay	6-Month HUF-BUBOR	2.420%	08/02/2026		20,200	(7)	(6)	0	(1)
Pay	6-Month HUF-BUBOR	4.790%	01/17/2027		6,500	(1)	(1)	0	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.000%	03/15/2022	PLN	1,900	(8)	(20)	0	(5)
Pay	6-Month PLN-WIBOR	2.500%	09/19/2023		700	(3)	(6)	2	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	1.790%	01/09/2024		1,300	16	16	0	(1)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	1.942%	03/20/2024		500	3	4	0	(1)
Pay	6-Month PLN-WIBOR	2.250%	03/20/2024		3,520	(21)	(45)	5	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.250%	06/19/2024		1,200	11	(3)	1	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	1.834%	07/03/2024		1,500	18	18	0	(1)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	0.655%	05/21/2025		300	8	8	0	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.500%	03/16/2026		100	1	1	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.460%	05/28/2026		100	(2)	(2)	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.330%	08/23/2026		100	(2)	(2)	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.930%	10/05/2026		200	(4)	(4)	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	2.375%	10/12/2026		200	(3)	(3)	0	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	3.004%	12/09/2026		200	2	2	0	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.950%	12/13/2026		100	1	1	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.097%	02/25/2027		100	(3)	(3)	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	0.663%	06/25/2027		600	(23)	2	0	(1)
Pay	6-Month PLN-WIBOR	3.250%	06/20/2028		300	(2)	(2)	0	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	1.490%	08/29/2029		400	14	14	0	(1)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	1.110%	01/12/2031		200	10	10	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.825%	03/10/2031		200	(6)	(7)	0	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.920%	12/13/2031		100	2	2	0	0
Receive	7-Day China Fixing Repo Rate	2.660%	12/16/2025	CNY	500	(1)	(1)	0	0
Pay	7-Day China Fixing Repo Rate	2.680%	03/17/2026		700	1	1	0	0

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ (評価損)	変動証拠金		
							資産	負債	
Pay	7-Day China Fixing Repo Rate	2.803%	03/17/2026	CNY	600	\$ 2	\$ 2	\$ 0	\$ 0
Pay	7-Day China Fixing Repo Rate	2.750%	09/15/2026		100	0	0	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	10.430%	03/02/2022	BRL	2,300	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.020%	01/02/2023		1,100	(15)	(12)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.030%	01/02/2023		700	(9)	(9)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.038%	01/02/2023		200	(3)	(3)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	4.045%	01/02/2023		1,500	18	19	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.070%	01/02/2023		700	(9)	(9)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.100%	01/02/2023		1,200	(15)	(15)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	4.605%	01/02/2023		700	8	8	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	4.640%	01/02/2023		1,000	11	11	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.000%	01/02/2023		200	1	1	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.150%	01/02/2023		1,700	11	18	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.250%	01/02/2023		1,600	(10)	(10)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.350%	01/02/2023		400	2	4	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.440%	01/02/2023		500	(2)	(2)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.745%	01/02/2023		100	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.920%	01/02/2023		700	(2)	(6)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.230%	01/02/2023		400	0	(1)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.410%	01/02/2023		1,000	(8)	(8)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.675%	01/02/2023		2,200	6	(9)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.195%	01/02/2023		800	6	6	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.260%	01/02/2023		1,200	8	8	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	10.415%	01/02/2023		1,400	(38)	(36)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.030%	01/02/2023		300	(10)	(10)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	4.720%	01/02/2024		800	16	13	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.870%	01/02/2024		2,300	(42)	(41)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.993%	01/02/2024		400	(7)	(7)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.100%	01/02/2024		700	12	12	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.160%	01/02/2024		1,000	17	17	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.680%	01/02/2024		1,600	(20)	(23)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	7.775%	01/02/2024		400	(4)	(4)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.790%	01/02/2024		200	2	2	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.300%	01/02/2024		200	(2)	(2)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	9.545%	01/02/2024		300	(1)	(1)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.755%	01/02/2024		100	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.833%	01/02/2024		200	(1)	(1)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.898%	01/02/2024		400	(1)	(1)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.995%	01/02/2024		50	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.065%	01/02/2024		100	0	0	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.505%	01/02/2024		300	0	0	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.530%	01/02/2024		900	1	1	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.535%	01/02/2024		300	0	0	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.540%	01/02/2024		300	0	0	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.543%	01/02/2024		300	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.290%	01/02/2024		300	1	1	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.710%	01/02/2025		300	(5)	(5)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.805%	01/02/2025		700	15	15	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.010%	01/02/2025		200	(3)	(3)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.710%	01/02/2025		2,000	18	31	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.810%	01/02/2025		400	3	3	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.160%	01/02/2025		100	1	1	0	0

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ (評価損)	変動証拠金		
							資産	負債	
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.480%	01/02/2025	BRL	1,000	\$ 3	\$ 11	\$ 0	\$ 0
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.475%	01/02/2025		600	3	3	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	8.615%	01/02/2025		500	(3)	7	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	8.700%	01/02/2025		700	(5)	(5)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	9.760%	01/02/2025		1,900	37	29	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.130%	01/02/2025		200	4	4	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.330%	01/02/2025		2,500	59	4	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.140%	01/04/2027		1,900	(46)	(37)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.180%	01/04/2027		400	10	9	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.245%	01/04/2027		1,100	28	29	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.250%	01/04/2027		100	2	2	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.350%	01/04/2027		200	(5)	(5)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.450%	01/04/2027		600	13	13	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.500%	01/04/2027		200	4	4	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.520%	01/04/2027		700	(14)	(16)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.550%	01/04/2027		500	12	12	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.950%	01/04/2027		100	(2)	(2)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.990%	01/04/2027		300	(5)	(5)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	7.115%	01/04/2027		300	(4)	(4)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.170%	01/04/2027		100	1	1	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	7.305%	01/04/2027		100	(1)	(1)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.770%	01/04/2027		400	7	7	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.800%	01/04/2027		400	3	5	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.355%	01/04/2027		100	(1)	(1)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.450%	01/04/2027		300	(4)	(4)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	8.635%	01/04/2027		500	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.675%	01/04/2027		500	0	(1)	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	8.750%	01/04/2027		600	6	7	0	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	10.090%	01/04/2027		100	(2)	(2)	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.995%	01/04/2027		100	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.020%	01/04/2027		300	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.045%	01/04/2027		100	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.048%	01/04/2027		200	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.050%	01/04/2027		200	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.055%	01/04/2027		100	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.065%	01/04/2027		100	0	0	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.350%	01/04/2027		100	2	1	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.760%	01/04/2027		1,100	4	4	0	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.250%	01/04/2027		300	9	9	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.490%	02/15/2023	COP	171,000	0	0	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.560%	02/14/2024		220,000	0	0	0	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	2.750%	07/24/2024		296,600	(9)	(5)	0	(1)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.885%	01/31/2025		126,000	1	1	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.500%	02/15/2025		61,000	0	0	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.855%	02/22/2025		174,900	0	0	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.060%	11/26/2025		64,000	2	2	0	(6)

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ (評価損)	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.690%	11/26/2025	COP 131,800	\$ 4	\$ 4	\$ 0	\$ (11)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.820%	11/26/2025	32,500	(1)	(1)	3	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.670%	11/26/2025	121,200	(2)	(2)	8	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.060%	02/05/2026	35,000	1	1	0	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.780%	10/04/2026	36,800	(1)	(1)	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.630%	01/11/2027	226,700	3	3	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.040%	01/25/2027	20,200	0	0	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.130%	01/31/2027	46,000	0	0	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.140%	02/01/2027	86,700	1	1	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.080%	02/02/2027	32,200	0	0	0	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.585%	02/14/2027	97,000	0	0	0	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.175%	05/28/2027	145,900	(4)	(4)	13	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.260%	11/03/2027	52,500	1	1	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.290%	11/03/2027	52,500	1	1	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.380%	11/03/2027	35,400	1	1	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.650%	11/03/2027	146,000	2	2	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.355%	11/18/2027	35,500	1	1	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.380%	01/21/2029	69,000	0	0	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.200%	09/18/2030	200,000	12	12	1	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.580%	09/18/2030	131,000	5	5	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.240%	02/09/2031	182,000	11	11	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.950%	03/26/2031	57,800	2	2	0	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.560%	03/26/2031	38,000	(1)	(1)	0	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.630%	10/07/2031	62,000	(1)	(1)	0	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.660%	10/07/2031	31,000	(1)	(1)	0	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.690%	10/07/2031	31,000	(1)	(1)	0	0
Receive(1)	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	5.750%	03/16/2027	INR 10,900	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	4.515%	08/17/2022	MXN 1,000	(1)	(1)	0	0
Receive	IBMEXID	4.535%	11/15/2022	2,000	2	2	0	0
Pay	IBMEXID	7.830%	12/15/2022	500	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.875%	12/16/2022	1,800	0	0	0	0

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ (評価損)	変動証拠金		
							資産	負債	
Pay	IBMEXID	7.880%	12/27/2022	MXN	800	\$ 0	\$ 0	\$ 1	\$ 0
Pay	IBMEXID	4.245%	02/15/2023		800	(1)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	4.350%	02/15/2023		4,000	(6)	(6)	0	0
Pay	IBMEXID	4.290%	02/16/2023		1,200	(2)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	4.300%	02/16/2023		6,200	(9)	(9)	0	0
Pay	IBMEXID	4.335%	02/21/2023		1,700	(3)	(3)	0	0
Pay	IBMEXID	4.470%	02/27/2023		300	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	4.520%	02/27/2023		500	(1)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	4.550%	02/27/2023		1,700	(2)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	4.560%	02/27/2023		300	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	4.565%	02/27/2023		300	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	6.590%	03/15/2023		5,100	2	2	0	0
Pay	IBMEXID	4.680%	03/16/2023		400	(1)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	7.150%	03/17/2023		5,900	(1)	(1)	0	0
Receive	IBMEXID	4.900%	03/22/2023		2,300	3	3	0	0
Receive	IBMEXID	6.360%	03/22/2023		1,500	1	3	0	0
Receive	IBMEXID	7.720%	03/24/2023		3,000	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	5.282%	03/29/2023		3,600	4	4	0	0
Receive	IBMEXID	4.920%	04/10/2023		3,100	4	4	0	0
Receive	IBMEXID	5.325%	06/09/2023		4,700	7	7	0	0
Pay	IBMEXID	8.335%	10/17/2023		2,300	1	1	0	0
Pay	IBMEXID	8.818%	11/16/2023		5,900	5	5	0	0
Pay	IBMEXID	7.270%	11/23/2023		6,100	(3)	(3)	0	0
Pay	IBMEXID	7.110%	11/28/2023		1,700	(1)	(1)	0	0
Receive	IBMEXID	8.900%	11/29/2023		800	(1)	(1)	0	0
Receive	IBMEXID	7.790%	02/09/2024		5,800	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	4.590%	02/20/2024		600	(2)	(2)	0	0
Receive	IBMEXID	4.540%	02/21/2024		800	2	2	0	0
Receive	IBMEXID	4.570%	02/21/2024		6,700	20	20	0	0
Pay	IBMEXID	4.695%	06/25/2024		1,700	(6)	(6)	0	(1)
Pay	IBMEXID	4.610%	06/27/2024		1,800	(6)	(6)	0	0
Receive	IBMEXID	4.870%	11/12/2024		600	2	2	0	0
Pay	IBMEXID	6.580%	01/01/2025		1,900	(3)	(3)	0	0
Pay	IBMEXID	6.620%	01/02/2025		2,500	(4)	(4)	0	0
Pay	IBMEXID	6.600%	01/13/2025		600	(1)	(1)	0	0
Receive	IBMEXID	6.635%	01/15/2025		2,900	5	6	0	0
Receive	IBMEXID	4.840%	02/19/2025		600	2	2	0	0
Receive	IBMEXID	4.850%	02/19/2025		900	4	4	0	0
Pay	IBMEXID	6.510%	02/24/2025		800	(1)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	6.415%	02/25/2025		300	(1)	(1)	0	0
Receive	IBMEXID	5.893%	06/05/2025		1,200	3	3	0	0
Pay	IBMEXID	4.775%	06/26/2025		200	(1)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	4.970%	08/08/2025		100	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	4.917%	08/11/2025		900	(4)	(4)	0	0
Pay	IBMEXID	4.980%	08/12/2025		500	(2)	(2)	0	0
Receive	IBMEXID	5.120%	09/29/2025		1,500	7	4	0	0
Receive	IBMEXID	4.770%	01/06/2026		600	3	3	0	0
Pay	IBMEXID	4.720%	02/06/2026		400	(2)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	4.730%	02/06/2026		1,100	(6)	(6)	0	0
Receive	IBMEXID	4.950%	02/11/2026		1,100	5	5	0	0
Receive	IBMEXID	4.950%	02/12/2026		400	2	2	0	0
Pay	IBMEXID	5.800%	04/06/2026		2,800	(10)	(10)	0	0

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ (評価損)	変動証拠金		
							資産	負債	
Receive	IBMEXID	6.670%	06/19/2026	MXN	300	\$ 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0
Receive	IBMEXID	6.720%	06/19/2026		200	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	6.845%	07/02/2026		1,100	2	2	0	0
Receive	IBMEXID	6.398%	07/16/2026		1,100	3	3	0	0
Receive	IBMEXID	6.415%	07/16/2026		400	1	1	0	0
Receive	IBMEXID	6.495%	07/17/2026		200	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	6.505%	07/17/2026		200	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	6.380%	08/19/2026		1,600	(4)	(4)	0	0
Pay	IBMEXID	7.285%	09/30/2026		100	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.165%	10/02/2026		300	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.180%	10/02/2026		900	(1)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	7.250%	10/05/2026		100	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.285%	10/12/2026		300	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	7.240%	12/16/2026		400	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	7.250%	12/16/2026		400	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.533%	01/07/2027		200	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	7.510%	02/04/2027		2,300	1	1	0	0
Receive	IBMEXID	6.565%	06/03/2027		700	2	2	0	0
Pay	IBMEXID	7.200%	06/11/2027		2,100	(3)	(4)	0	0
Pay	IBMEXID	7.990%	03/16/2028		1,100	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	8.000%	03/16/2028		12,000	5	5	0	(1)
Pay	IBMEXID	7.977%	03/17/2028		3,600	1	1	0	0
Receive	IBMEXID	9.045%	10/19/2028		9,300	(30)	(30)	1	0
Receive	IBMEXID	9.210%	11/08/2028		1,100	(4)	(4)	0	0
Receive	IBMEXID	9.090%	11/09/2028		2,200	(7)	(7)	0	0
Receive	IBMEXID	9.100%	11/09/2028		3,600	(12)	(12)	1	0
Receive	IBMEXID	9.330%	11/16/2028		2,700	(11)	(11)	1	0
Pay	IBMEXID	8.970%	12/11/2028		3,400	10	10	0	(1)
Receive	IBMEXID	8.540%	01/25/2029		1,000	(2)	(2)	0	0
Receive	IBMEXID	8.430%	01/29/2029		2,100	(3)	(4)	0	0
Pay	IBMEXID	7.675%	06/04/2029		2,400	(1)	(5)	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.845%	11/02/2029		400	1	1	0	0
Receive	IBMEXID	6.830%	12/27/2029		900	3	3	0	0
Pay	IBMEXID	5.990%	01/08/2030		1,300	(7)	4	0	0
Receive	IBMEXID	6.618%	01/18/2030		1,200	4	4	0	0
Receive	IBMEXID	6.600%	02/26/2030		900	4	6	0	0
Receive	IBMEXID	7.750%	03/08/2030		2,200	1	1	1	0
Pay	IBMEXID	5.865%	06/13/2030		1,400	(9)	(9)	0	0
Receive	IBMEXID	5.590%	07/03/2030		700	5	5	0	0
Receive	IBMEXID	5.610%	07/03/2030		900	6	6	0	0
Pay	IBMEXID	5.540%	12/31/2030		300	(2)	(2)	0	0
Receive	IBMEXID	5.445%	01/13/2031		800	6	6	0	0
Pay	IBMEXID	5.980%	02/12/2031		300	(2)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	5.990%	02/12/2031		700	(4)	(4)	0	0
Pay	IBMEXID	6.040%	02/12/2031		2,400	(14)	(14)	0	0
Receive	IBMEXID	6.630%	03/31/2031		800	3	3	0	0
Receive	IBMEXID	6.550%	04/04/2031		200	1	1	0	0
Pay	IBMEXID	6.678%	05/29/2031		1,600	(7)	(5)	0	0
Pay	IBMEXID	6.715%	05/30/2031		1,100	(4)	(4)	0	0
Receive	IBMEXID	7.100%	06/13/2031		1,000	2	3	0	0
Receive	IBMEXID	7.070%	08/27/2031		1,100	3	3	0	0
Pay	IBMEXID	7.650%	09/24/2031		100	0	0	0	0

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ (評価損)	変動証拠金		
							資産	負債	
Pay	IBMEXID	7.525%	09/26/2031	MXN	600	\$ (1)	\$ (1)	\$ 0	\$ 0
Pay	IBMEXID	7.650%	09/29/2031		100	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.600%	10/08/2031		100	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.700%	10/10/2031		100	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.690%	10/16/2031		300	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.418%	10/27/2031		300	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	7.784%	11/13/2031		1,300	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	7.800%	11/13/2031		300	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	7.643%	11/18/2031		400	0	0	0	0
Pay(1)	IBMEXID	7.875%	02/17/2032		400	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	7.755%	02/02/2034		200	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	8.280%	11/28/2036		200	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	8.310%	11/28/2036		200	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	8.540%	02/16/2039		200	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	8.545%	02/16/2039		500	1	1	0	0
Pay	IBMEXID	7.890%	05/27/2039		4,200	(7)	(18)	0	0
Pay	IBMEXID	7.625%	07/12/2039		400	(1)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	7.640%	07/13/2039		600	(2)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	7.127%	08/10/2039		200	(1)	(1)	0	0
Receive	IBMEXID	7.210%	10/28/2039		200	1	1	1	0
Receive	IBMEXID	7.253%	10/28/2039		400	2	2	0	0
Receive	IBMEXID	7.180%	10/31/2039		600	3	3	0	0
Receive	IBMEXID	7.200%	10/31/2039		400	2	2	0	0
Receive	IBMEXID	7.065%	12/26/2039		500	3	3	0	0
Receive	IBMEXID	6.463%	05/18/2040		200	2	2	0	0
Receive	IBMEXID	6.540%	05/31/2040		900	8	8	0	0
Receive	IBMEXID	6.430%	06/04/2040		1,600	14	6	0	0
Receive	IBMEXID	6.380%	06/05/2040		500	5	5	0	0
Receive	IBMEXID	6.260%	06/07/2040		500	5	5	0	0
Receive	IBMEXID	6.465%	09/26/2040		400	4	4	0	0
Pay	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	1.750%	12/15/2026	KRW	315,200	(7)	(7)	7	0
Receive	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	2.000%	12/15/2026		8,200	0	0	0	0
Receive	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	1.750%	12/15/2031		157,000	7	6	0	(6)
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.562%	02/14/2024	\$	300	(1)	(1)	0	(2)
Receive(1)	Secured Overnight Financing Rate	1.950%	02/24/2024		1,200	(2)	(2)	0	(3)
Receive(1)	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2027		200	6	3	0	(2)
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.832%	02/14/2032		60	1	1	2	0
Pay(1)	Secured Overnight Financing Rate	1.250%	06/15/2032		100	(4)	(3)	2	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.500%	01/27/2023	CLP	151,000	(3)	(3)	3	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.510%	01/27/2023		156,000	(3)	(3)	4	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.530%	01/28/2023		64,000	(1)	(1)	2	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.540%	01/28/2023		62,000	(1)	(1)	2	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.560%	01/28/2023		163,000	(3)	(3)	4	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.870%	02/07/2023		68,000	(1)	(1)	1	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.900%	02/07/2023		64,000	(1)	(1)	1	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.905%	02/07/2023		21,000	0	0	1	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.920%	02/07/2023		68,000	(1)	(1)	1	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.920%	02/08/2023		119,000	(2)	(2)	2	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.110%	12/14/2023		46,600	2	2	0	(1)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.170%	12/14/2023		19,400	1	1	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.040%	12/17/2023		9,000	(1)	(1)	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.785%	01/06/2024		57,000	(2)	(2)	1	0

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ (評価損)	変動証拠金		
							資産	負債	
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.585%	12/04/2024	CLP	37,000	\$ 5	\$ 5	\$ 0	\$ 0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.590%	12/04/2024		38,000	5	5	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.635%	12/04/2024		30,000	4	4	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.650%	12/04/2024		30,000	4	4	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.780%	12/09/2024		31,000	(4)	(4)	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.880%	01/14/2025		7,500	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.945%	01/18/2025		40,400	(1)	(1)	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.590%	01/27/2025		16,000	1	1	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.595%	01/27/2025		37,000	2	2	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.600%	01/27/2025		37,000	2	2	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.610%	01/27/2025		38,000	2	2	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.620%	01/27/2025		23,000	1	1	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.720%	01/28/2025		44,000	2	2	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.754%	01/28/2025		36,000	1	1	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.760%	01/28/2025		21,000	1	1	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.915%	02/01/2025		38,600	1	1	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.393%	02/05/2025		72,000	(11)	(11)	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.725%	02/07/2025		47,000	2	2	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.750%	02/07/2025		15,000	1	1	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.760%	02/07/2025		48,000	2	2	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.795%	02/07/2025		47,000	2	2	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.770%	02/08/2025		81,000	3	3	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.335%	02/10/2025		20,000	0	0	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.350%	02/10/2025		31,000	1	1	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.315%	02/11/2025		38,000	1	1	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.350%	02/11/2025		74,000	1	1	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.130%	03/01/2025		10,000	1	1	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.425%	03/01/2025		10,000	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.940%	03/01/2025		30,000	(1)	(1)	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.935%	03/10/2025		28,800	5	5	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.940%	03/10/2025		14,400	3	3	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.840%	03/13/2025		15,000	3	3	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.810%	03/30/2025		68,000	13	13	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.085%	05/27/2025		88,700	(19)	(19)	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.290%	11/05/2025		38,400	9	9	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.600%	01/28/2026		75,000	(13)	(13)	1	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.545%	02/05/2026		29,000	(5)	(5)	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.780%	02/17/2026		26,000	5	5	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.785%	02/17/2026		12,000	3	3	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.790%	02/17/2026		46,000	10	10	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.640%	03/01/2026		30,000	5	5	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.260%	03/01/2026		10,000	1	1	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.950%	05/05/2026		54,800	(12)	(12)	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.530%	07/06/2026		14,000	2	2	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.530%	08/06/2026		15,100	2	2	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.320%	08/30/2026		23,300	5	5	0	(5)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.335%	09/03/2026		26,100	5	5	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.870%	11/15/2026		10,000	(1)	(1)	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.045%	12/14/2026		6,500	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.622%	01/10/2027		45,700	(2)	(2)	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.865%	01/14/2027		8,600	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.910%	01/21/2027		16,900	0	0	0	0

支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	市場価格	評価益/ (評価損)	変動証拠金						
							資産	負債					
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.613%	02/07/2027	CLP	15,000	\$ (1)	\$ (1)	\$ 0	\$ 0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.630%	02/07/2027		14,000	(1)	(1)	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.640%	02/07/2027		5,000	0	0	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.687%	02/07/2027		15,000	0	0	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.610%	02/08/2027		26,000	(1)	(1)	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.030%	02/10/2027		20,000	0	0	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.055%	02/10/2027		12,000	0	0	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.975%	02/11/2027		24,000	0	0	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.000%	02/11/2027		47,000	(1)	(1)	0	0				
Pay(1)	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.270%	03/02/2027		6,100	0	0	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.684%	06/04/2027		67,000	(18)	(18)	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.715%	06/04/2027		13,400	(4)	(4)	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.947%	11/23/2027		38,000	10	10	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.965%	11/24/2027		24,600	6	6	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.000%	11/25/2027		14,000	4	4	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.020%	11/25/2027		19,000	5	5	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.245%	12/10/2027		5,000	(1)	(1)	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.255%	12/10/2027		21,000	(5)	(5)	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.520%	06/14/2028		4,600	1	1	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.990%	07/06/2028		14,000	2	2	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.000%	07/06/2028		7,000	1	1	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.725%	07/19/2028		14,100	2	2	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.731%	07/20/2028		38,000	6	6	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.920%	08/06/2028		25,500	4	4	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.015%	09/13/2028		12,400	(1)	(1)	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.170%	10/01/2028		16,650	2	2	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.870%	10/01/2028		10,000	(1)	(1)	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.180%	10/01/2028		5,000	0	0	0	0				
Pay(1)	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.990%	03/02/2029		9,000	0	0	0	0				
Pay(1)	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.020%	03/02/2029		2,900	0	0	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.635%	09/23/2029		14,100	(4)	(4)	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.215%	01/14/2030		66,600	15	15	0	(1)				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.120%	02/05/2030		9,000	(2)	(2)	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.935%	05/27/2030		45,700	15	15	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.080%	06/01/2030		12,000	(4)	(4)	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.110%	06/01/2030		5,000	(2)	(2)	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.420%	09/01/2030		5,000	1	1	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.240%	09/01/2030		9,000	0	0	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.470%	09/01/2030		10,000	0	0	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.795%	02/11/2031		10,000	(3)	(3)	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.800%	02/11/2031		5,000	(1)	(1)	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.805%	02/11/2031		10,000	(3)	(3)	0	0				
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.640%	04/30/2031		6,400	1	1	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.100%	11/15/2031		2,000	0	0	0	0				
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.120%	11/15/2031		2,000	0	0	0	0				
Receive(1)	Singapore Overnight Index Average	1.000%	03/16/2023	SGD	530	0	0	0	0				
Receive(1)	Singapore Overnight Index Average	1.250%	03/16/2024		400	1	0	0	0				
Receive	Singapore Overnight Index Average	1.250%	09/15/2031		40	1	2	0	0				
Pay(1)	Singapore Overnight Index Average	1.750%	03/16/2032		60	0	0	0	0				
スワップ合計						\$	132	\$	82	\$	77	\$	(58)

金融デリバティブ商品：上場または集中決済の概要

以下は、2022年2月28日時点の上場または集中決済金融デリバティブ商品の時価、変動証拠金をまとめたものです。

2022年2月28日時点、現金108米ドルは上場および集中決済金融デリバティブ商品の担保となっております。

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債					
	時価		変動証拠金資産		合計	時価		変動証拠金負債		合計
	買建オプション	先物	スワップ			売建オプション	先物	スワップ		
上場または集中決済合計	\$ 0	\$ 0	\$ 77	\$ 77	\$ 0	\$ (3)	\$ (58)	\$ (61)		

(1) この金融商品には、先渡取引の効力発生日があります。

(e) 金融デリバティブ商品：店頭
先渡為替予約

契約先	決済月	引渡通貨	受取通貨	評価益/ (評価損)					
				資産	負債				
BOA	03/2022	BRL	59	\$	11	\$	0	\$	0
BOA	03/2022	CNY	19		3		0		0
BOA	03/2022	KZT	10,287		23		2		0
BOA	03/2022	MXN	1,054		51		0		(1)
BOA	03/2022	PEN	23		6		0		0
BOA	03/2022	SGD	4		3		0		0
BOA	03/2022	THB	132		4		0		0
BOA	03/2022	\$	11	BRL	59		0		0
BOA	03/2022		53	CLP	42,348		0		0
BOA	03/2022		20	COP	80,500		1		0
BOA	03/2022		27	MXN	572		1		0
BOA	03/2022		118	MYR	499		0		0
BOA	03/2022		7	PLN	29		0		0
BOA	03/2022		7	TRY	97		0		0
BOA	04/2022	MXN	212	\$	10		0		(1)
BOA	04/2022	\$	6	TRY	68		0		(2)
BOA	05/2022		68	MXN	1,429		1		0
BOA	05/2022		18	ZAR	277		0		0
BOA	06/2022		31	PEN	129		3		0
BOA	06/2022		197	ZAR	3,011		0		(5)
BOA	07/2022		77	PEN	311		4		0
BOA	11/2022	ZAR	88	\$	6		0		0
BOA	01/2023	CNH	779		121		0		(1)
BOA	02/2023	\$	121	CNH	779		1		0
BPS	03/2022	BRL	37	\$	7		0		0
BPS	03/2022	CNH	151		24		0		0
BPS	03/2022	COP	35,843		9		0		0
BPS	03/2022	HUF	29,624		96		6		0
BPS	03/2022	IDR	695,498		49		0		0
BPS	03/2022		386,698		27		0		0
BPS	03/2022		91,184		6		0		0
BPS	03/2022	MXN	1,097		54		0		0
BPS	03/2022	MYR	352		83		0		(1)
BPS	03/2022	PLN	37		9		0		0
BPS	03/2022	THB	416		13		0		0
BPS	03/2022		1,243		37		0		(1)
BPS	03/2022	\$	7	BRL	37		0		0
BPS	03/2022		57	CLP	45,498		1		0
BPS	03/2022		187	CNH	1,193		2		0
BPS	03/2022		8	COP	33,076		0		0
BPS	03/2022		119	CZK	2,571		0		(5)
BPS	03/2022		100	HUF	31,042		0		(6)

契約先	決済月	引渡通貨	受取通貨	評価益/ (評価損)		
				資産	負債	
BPS	03/2022	\$	1 IDR	13,126	\$ 0	\$ 0
BPS	03/2022		41 MXN	853	0	0
BPS	03/2022		20 MYR	84	0	0
BPS	03/2022		6 PHP	299	0	0
BPS	03/2022		7 PLN	30	0	0
BPS	03/2022		54 RON	233	0	(1)
BPS	03/2022		5 THB	153	0	0
BPS	03/2022		8	258	0	0
BPS	03/2022		53 TRY	745	0	(2)
BPS	04/2022	BRL	166 \$	32	0	0
BPS	04/2022	\$	7 ZAR	107	0	0
BPS	05/2022		173 MXN	3,597	1	0
BPS	05/2022	ZAR	21 \$	1	0	0
BPS	07/2022	\$	47 MXN	975	0	0
BPS	08/2022	CNH	779 \$	117	0	(5)
BPS	08/2022	ZAR	86	5	0	0
BPS	09/2022	CNH	779	118	0	(4)
BPS	09/2022	\$	117 CNH	779	5	0
BPS	10/2022	CNH	779 \$	117	0	(4)
BPS	10/2022	\$	117 CNH	779	5	0
BPS	11/2022	CNH	779 \$	119	0	(3)
BPS	11/2022	\$	117 CNH	779	5	0
BPS	11/2022	ZAR	148 \$	9	0	0
BPS	12/2022	CNH	779	119	0	(2)
BPS	12/2022	TRY	403	31	8	0
BPS	12/2022	\$	119 CNH	779	3	0
BPS	01/2023		119	779	2	0
BRC	03/2022	BRL	69 \$	14	0	0
BRC	03/2022	MYR	412	98	0	0
BRC	03/2022	THB	810	24	0	(1)
BRC	03/2022	\$	137 MYR	584	2	0
BRC	04/2022		1 TRY	14	0	0
BRC	11/2022	ZAR	37 \$	2	0	0
BSS	04/2022	\$	12 CLP	9,822	0	0
BSS	05/2022	CLP	19,438 \$	23	0	(1)
BSS	05/2022		5,000	6	0	0
CBK	03/2022	BRL	82	16	0	0
CBK	03/2022	CLP	7,883	9	0	(1)
CBK	03/2022		23,509	29	0	(1)
CBK	03/2022	COP	575,777	144	0	(4)
CBK	03/2022	EUR	3	3	0	0
CBK	03/2022	IDR	71,998	5	0	0
CBK	03/2022	ILS	100	30	0	(1)
CBK	03/2022	PEN	50	13	0	0
CBK	03/2022		161	39	0	(3)
CBK	03/2022	THB	203	6	0	0
CBK	03/2022		3,511	105	0	(3)
CBK	03/2022	\$	15 BRL	82	1	0
CBK	03/2022		23 CLP	18,424	1	0
CBK	03/2022		5	4,242	0	0
CBK	03/2022		10	7,883	0	0
CBK	03/2022		64 COP	253,004	1	0
CBK	03/2022		3 EUR	3	0	0
CBK	03/2022		8 KZT	3,763	0	(1)
CBK	03/2022		33 PEN	123	0	(1)
CBK	03/2022		59	229	1	0

契約先	決済月	引渡通貨	受取通貨	評価益/ (評価損)				
				資産	負債			
CBK	03/2022	\$	12 PEN	50	\$	1	\$	0
CBK	03/2022		35	144		3		0
CBK	03/2022		45 RUB	3,359		0		(10)
CBK	03/2022		38 THB	1,283		1		0
CBK	03/2022		6 UYU	268		0		0
CBK	04/2022	ILS	500	\$	153	0		(3)
CBK	04/2022	MXN	103		5	0		0
CBK	04/2022	PEN	502		125	0		(7)
CBK	04/2022	THB	1,962		61	1		0
CBK	04/2022		1,549		48	1		0
CBK	04/2022	\$	59 THB	1,962		1		0
CBK	04/2022		46	1,549		1		0
CBK	04/2022		2 TRY	27		0		(1)
CBK	05/2022		143 PEN	583		10		0
CBK	05/2022		12	50		1		0
CBK	05/2022		2 RUB	156		0		0
CBK	06/2022	ILS	400	\$	123	0		(2)
CBK	06/2022	\$	51 IDR	737,590		0		0
CBK	06/2022		9 VND	206,847		0		0
CBK	08/2022	ILS	304	\$	92	0		(3)
CBK	08/2022	\$	108 COP	436,221		1		0
CBK	11/2022	PEN	229	\$	58	0		(1)
CBK	11/2022	\$	13 PEN	50		0		0
CBK	12/2022	PEN	1,210	\$	288	0		(21)
CBK	12/2022	\$	10 TRY	159		0		(1)
CBK	02/2023	PEN	119	\$	30	0		0
DUB	03/2022	CNH	752		118	0		(1)
DUB	03/2022	ILS	195		61	0		0
DUB	03/2022	MYR	94		22	0		0
DUB	03/2022	THB	305		10	0		0
DUB	03/2022	\$	27 COP	111,321		2		0
DUB	03/2022		49 CZK	1,057		0		(2)
DUB	03/2022		164 PLN	652		0		(8)
DUB	05/2022	TRY	59	\$	4	0		0
DUB	05/2022	\$	5 RUB	414		0		(1)
GLM	03/2022	BRL	2,801	\$	545	1		0
GLM	03/2022		88	17		0		0
GLM	03/2022	CLP	4,765		6	0		0
GLM	03/2022	IDR	260,036		18	0		0
GLM	03/2022		361,125	25		0		0
GLM	03/2022	THB	9		0	0		0
GLM	03/2022	\$	508 BRL	2,801		36		0
GLM	03/2022		34 CLP	27,629		1		0
GLM	03/2022		0 CNY	0		0		0
GLM	03/2022		22 COP	86,306		0		0
GLM	03/2022		2 INR	151		0		0
GLM	03/2022		8 KZT	3,579		0		(1)
GLM	03/2022		46 MYR	194		1		0
GLM	03/2022		90 PLN	364		0		(3)
GLM	04/2022	TRY	116	\$	11	3		0
GLM	04/2022	\$	71 BRL	365		0		(1)
GLM	05/2022	CLP	9,395	\$	11	0		0
GLM	05/2022		14,122	17		0		(1)
GLM	05/2022	DOP	5,246		89	0		(5)
GLM	05/2022	TRY	381		26	1		0
GLM	05/2022	\$	5 RUB	385		0		(1)

契約先	決済月	引渡通貨		受取通貨		評価益/ (評価損)	
						資産	負債
GLM	05/2022	ZAR	63	\$	4	\$	0
GLM	06/2022	\$	8	ZAR	128		0
GLM	08/2022		108	DOP	6,304	3	0
GLM	11/2022	ILS	100	\$	32	1	0
GLM	11/2022	ZAR	93		6	0	0
HUS	03/2022	CLP	9,588		12	0	0
HUS	03/2022	MYR	207		49	0	0
HUS	03/2022	SGD	14		10	0	0
HUS	03/2022	\$	12	CLP	9,588	0	0
HUS	03/2022		61	ILS	200	1	0
HUS	03/2022		47	MYR	196	0	0
HUS	03/2022		12	RUB	935	0	(3)
HUS	04/2022		10	CLP	8,247	0	0
HUS	04/2022		61	ILS	200	1	0
HUS	05/2022	CLP	9,719	\$	12	0	0
IND	04/2022	ZAR	107		7	0	0
IND	06/2022	TWD	452		17	1	0
IND	06/2024	\$	18	TWD	463	0	(1)
JPM	03/2022	CLP	9,677	\$	12	0	0
JPM	03/2022	CNH	329		52	0	(1)
JPM	03/2022	CNY	731		115	0	(1)
JPM	03/2022	COP	64,688		16	0	(1)
JPM	03/2022	CZK	1,267		59	3	0
JPM	03/2022	KZT	1,804		4	0	0
JPM	03/2022	SGD	18		13	0	0
JPM	03/2022	UAH	398		14	1	0
JPM	03/2022	\$	28	CLP	22,883	0	0
JPM	03/2022		1	COP	3,921	0	0
JPM	03/2022		27	EUR	24	0	0
JPM	03/2022		7	HUF	2,340	0	0
JPM	03/2022		1	IDR	9,485	0	0
JPM	03/2022		3	KRW	3,530	0	0
JPM	03/2022		13	KZT	5,647	0	(1)
JPM	03/2022		51	MXN	1,057	1	0
JPM	03/2022		331	THB	11,231	13	0
JPM	03/2022		2	UYU	88	0	0
JPM	04/2022	TRY	696	\$	70	24	0
JPM	04/2022	UAH	404		13	2	0
JPM	04/2022	\$	5	TRY	71	0	0
JPM	05/2022	COP	205,634	\$	52	0	0
JPM	05/2022	\$	210	MXN	4,362	1	0
JPM	06/2022	TRY	245	\$	16	0	0
JPM	06/2022	\$	10	VND	230,500	0	0
JPM	06/2022	ZAR	262	\$	17	0	0
JPM	07/2022	\$	9	VND	208,800	0	0
JPM	12/2022		34	TRY	568	0	(1)
MYI	03/2022	BRL	2,844	\$	550	0	(2)
MYI	03/2022	CLP	51,041		64	0	0
MYI	03/2022		18,424		23	0	0
MYI	03/2022		97,862		123	0	0
MYI	03/2022	IDR	41,173		3	0	0
MYI	03/2022	KZT	898		2	0	0
MYI	03/2022	MXN	560		27	0	0
MYI	03/2022	MYR	113		27	0	0
MYI	03/2022	THB	1,048		31	0	(1)
MYI	03/2022	UAH	422		15	1	0

契約先	決済月	引渡通貨	受取通貨	評価益/ (評価損)	
				資産	負債
MYI	03/2022	\$	553 BRL	2,844	\$ 0 (1)
MYI	03/2022		7 CLP	5,619	0 0
MYI	03/2022		118	97,862	5 0
MYI	03/2022		87 IDR	1,247,610	0 0
MYI	03/2022		14 MYR	59	0 0
MYI	03/2022		23 THB	780	1 0
MYI	03/2022		35 UAH	986	0 (3)
MYI	04/2022		545 BRL	2,844	2 0
MYI	04/2022		23 CLP	18,424	0 0
MYI	04/2022		0 TRY	1	0 0
MYI	05/2022	CLP	84,016 \$	100	0 (4)
MYI	05/2022	\$	2 RUB	149	0 0
MYI	05/2022		1 ZAR	21	0 0
MYI	05/2022	ZAR	214 \$	14	0 0
MYI	12/2022	TRY	366	29	8 0
NGF	08/2022	\$	94 CNH	625	4 0
RBC	03/2022	BRL	33 \$	6	0 0
RBC	03/2022	\$	6 BRL	33	0 0
RBC	03/2022		11 CLP	8,938	0 0
RBC	03/2022		17 MXN	348	0 0
RBC	06/2022	MXN	348 \$	17	0 0
RYL	03/2022		61	3	0 0
SCX	03/2022	BRL	21	4	0 0
SCX	03/2022	CLP	132,692	157	0 (10)
SCX	03/2022	CNY	971	152	0 (1)
SCX	03/2022	IDR	398,942	28	0 0
SCX	03/2022	MYR	627	148	0 (1)
SCX	03/2022	RUB	603	8	2 0
SCX	03/2022	\$	4 BRL	21	0 0
SCX	03/2022		166 CLP	132,692	1 0
SCX	03/2022		1 IDR	15,091	0 0
SCX	03/2022		75 MYR	318	0 0
SCX	03/2022		2 THB	75	0 0
SCX	03/2022		9 UAH	253	0 (1)
SCX	04/2022		8 RUB	636	0 (2)
SCX	06/2022	THB	3,941 \$	122	1 0
SCX	07/2022	\$	9 VND	208,260	0 0
SCX	08/2022		23 CNH	154	1 0
SCX	08/2022		6 ZAR	86	0 0
SOG	03/2022	BRL	36 \$	7	0 0
SOG	03/2022	HUF	9,573	31	2 0
SOG	03/2022	\$	7 BRL	36	0 0
SOG	05/2022		3 RUB	230	0 (1)
SSB	03/2022	MYR	292 \$	69	0 0
SSB	03/2022	PEN	45	11	0 (1)
TOR	03/2022	\$	33 MXN	706	1 0
UAG	03/2022	CLP	33,125 \$	42	0 0
UAG	03/2022	HUF	2,639	8	0 0
UAG	03/2022	IDR	158,454	11	0 0
UAG	03/2022	MXN	764	37	0 0
UAG	03/2022	SGD	198	146	0 0
UAG	03/2022	\$	14 CLP	11,316	0 0
UAG	03/2022		40	33,125	2 0
UAG	03/2022		15 RUB	1,143	0 (3)
UAG	03/2022		7 THB	233	0 0
UAG	03/2022	ZAR	87 \$	6	0 0

契約先	決済月	引渡通貨	受取通貨	評価益/(評価損)		
				資産	負債	
UAG	04/2022	TRY	336 \$	32	\$ 9	\$ 0
UAG	04/2022	\$	31 RUB	2,362	0	(8)
UAG	05/2022	MXN	2,723 \$	132	0	0
UAG	05/2022	\$	4 RUB	316	0	(1)
UAG	06/2022	ZAR	199 \$	13	0	0
UAG	11/2022	\$	37 ZAR	574	0	(1)
UAG	11/2022	ZAR	207 \$	13	0	0
UAG	02/2023	CNH	779	121	0	0
先渡為替予約合計					\$ 215	\$ (184)

**売建オプション
金利スワップション**

契約先	銘柄	変動金利 インデックス	支払(Pay)/ 受取 (Receive) 変動金利	権利行使 レート	満期日	想定 元本金額 ⁽¹⁾	プレミアム (受取)	市場価格
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.700%	04/07/2022	300 \$	(1) \$	(1)
売建オプション合計							\$ (1)	\$ (1)

**スワップ
通貨スワップ**

契約先	受取	支払	満期日 ⁽²⁾	受取通貨の 想定元本 金額 ⁽³⁾	引渡通貨の 想定元本 金額 ⁽³⁾	支払/ (受取) プレミアム	評価益/ (評価損)	スワップ評価金額	
								資産	負債
GLM	Floating rate equal to 6-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency delivered	Fixed rate equal to 33.250% based on the notional amount of currency received	05/30/2024	ARS1,334	\$ 30	\$ 0	24 \$	24 \$	0

金利スワップ

契約先	支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	支払/(受取) プレミアム	評価益/ (評価損)	スワップ評価金額	
								資産	負債
BOA	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.800%	04/24/2028	ILS 700	\$ 0	\$ 8	\$ 8	\$ 0
BOA	Pay	3-Month MYR-KLIBOR	3.000%	06/16/2031	MYR 250	0	2	2	0
BOA	Receive	3-Month MYR-KLIBOR	3.000%	09/15/2031	150	0	1	1	0
BPS	Pay	3-Month MYR-KLIBOR	3.000%	06/16/2031	100	0	1	1	0
BPS	Receive	3-Month MYR-KLIBOR	3.250%	12/15/2031	100	0	1	1	0
BRC	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.513%	08/12/2024	ILS 400	0	2	2	0
BRC	Pay	3-Month ILS-TELBOR	1.808%	11/30/2027	900	0	6	6	0
BSS	Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.790%	03/14/2026	CLP 81,100	0	(10)	0	(10)
CBK	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.950%	05/23/2024	ILS 500	0	(1)	0	(1)
CBK	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.485%	08/09/2024	200	0	1	1	0
CBK	Pay	3-Month ILS-TELBOR	1.810%	11/29/2027	ILS 300	0	2	2	0
CBK	Pay	7-Day China Fixing Repo Rate	2.805%	03/17/2026	CNY 600	0	(1)	0	(1)
CBK	Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.763%	05/24/2029	CLP 9,000	0	(2)	0	(2)
DUB	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.690%	09/27/2027	500	0	6	6	0
GLM	Pay	3-Month ILS-TELBOR	1.048%	02/27/2024	1,000	0	0	0	0
GLM	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.950%	05/23/2024	300	0	0	0	0
GLM	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.960%	05/24/2024	1,000	0	(1)	0	(1)
GLM	Pay	3-Month ILS-TELBOR	1.898%	12/17/2025	100	0	1	1	0
GLM	Receive	3-Month MYR-KLIBOR	3.000%	09/15/2031	MYR 50	0	1	1	0

契約先	支払(Pay)/ 受取(Receive) 変動金利	変動金利 インデックス	固定 金利	満期日	想定 元本金額	支払/(受取) プレミアム	評価益/ (評価損)	スワップ評価金額	
								資産	負債
GLM	Pay(4)	6-Month Thailand Fixing Rate	1.500%	06/15/2027	THB 1,200	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
GLM	Pay	6-Month Thailand Fixing Rate	1.750%	12/15/2031	300	0	0	0	0
GLM	Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.570%	10/05/2022	CLP 20,100	0	1	1	0
GLM	Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.040%	03/18/2029	15,300	0	(2)	0	(2)
GLM	Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.265%	06/14/2029	23,300	0	(5)	0	(5)
GLM	Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.990%	08/01/2029	64,000	0	(15)	0	(15)
GST	Pay	6-Month Thailand Fixing Rate	1.500%	12/15/2031	THB 400	0	0	0	0
JPM	Pay	3-Month ILS-TELBOR	0.968%	03/26/2024	ILS 1,700	0	3	3	0
JPM	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.475%	08/09/2024	300	0	1	1	0
MYC	Receive	6-Month Thailand Fixing Rate	1.000%	12/15/2026	THB 500	0	0	0	0
MYC	Receive	6-Month Thailand Fixing Rate	1.250%	12/15/2026	1,300	0	0	0	0
MYC	Pay	6-Month Thailand Fixing Rate	1.500%	12/15/2031	800	0	0	0	0
MYC	Pay	6-Month Thailand Fixing Rate	1.750%	12/15/2031	1,700	(1)	0	0	(1)
NGF	Receive	6-Month Thailand Fixing Rate	1.000%	12/15/2026	8,600	0	4	4	0
NGF	Pay	6-Month Thailand Fixing Rate	1.415%	02/23/2027	1,800	0	0	0	0
NGF	Pay(4)	6-Month Thailand Fixing Rate	1.500%	06/15/2027	1,700	0	0	0	0
NGF	Pay	6-Month Thailand Fixing Rate	1.500%	12/15/2031	1,400	(1)	(1)	0	(2)
SCX	Pay	3-Month Shanghai Interbank Offered Rate	2.970%	02/14/2025	CNY 600	0	1	1	0
SCX	Pay	6-Month Thailand Fixing Rate	1.750%	12/15/2031	THB 400	0	0	0	0
						\$ (2)	\$ 4	\$ 42	\$ (40)
スワップ合計						\$ (2)	\$ 28	\$ 66	\$ (40)

金融デリバティブ商品：店頭の概要

以下は、2022年2月28日時点の店頭金融デリバティブ商品および差入／（受入）担保の市場価格を契約先別に分類して要約したものです。

契約先	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭 デリバティブの 市場価格(純額)	差入／ (受入)担保	ネットエク スポージャー ⁽⁵⁾
	先渡 為替予約	買建 オプション	スワップ	店頭合計	先渡 為替予約	売建 オプション	スワップ	店頭 合計			
BOA	\$ 13	\$ 0	\$ 11	\$ 24	\$ (10)	\$ 0	\$ 0	\$ (10)	\$ 14	\$ 0	\$ 14
BPS	38	0	2	40	(34)	0	0	(34)	6	0	6
BRC	2	0	8	10	(1)	0	0	(1)	9	0	9
BSS	0	0	0	0	(1)	0	(10)	(11)	(11)	0	(11)
CBK	25	0	3	28	(64)	(1)	(4)	(69)	(41)	0	(41)
DUB	2	0	6	8	(12)	0	0	(12)	(4)	0	(4)
GLM	47	0	27	74	(12)	0	(23)	(35)	39	0	39
GST	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
HUS	2	0	0	2	(3)	0	0	(3)	(1)	0	(1)
IND	1	0	0	1	(1)	0	0	(1)	0	0	0
JPM	45	0	4	49	(5)	0	0	(5)	44	0	44
MYC	0	0	0	0	0	0	(1)	(1)	(1)	0	(1)
MYI	17	0	0	17	(11)	0	0	(11)	6	0	6
NGF	4	0	4	8	0	0	(2)	(2)	6	0	6
RBC	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
RYL	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
SCX	5	0	1	6	(15)	0	0	(15)	(9)	0	(9)
SOG	2	0	0	2	(1)	0	0	(1)	1	0	1
SSB	0	0	0	0	(1)	0	0	(1)	(1)	0	(1)
TOR	1	0	0	1	0	0	0	0	1	0	1
UAG	11	0	0	11	(13)	0	0	(13)	(2)	0	(2)
店頭合計	\$ 215	\$ 0	\$ 66	\$ 281	\$ (184)	\$ (1)	\$ (40)	\$ (225)			

- (1) 想定元本金額は契約数を示します。
- (2) 満期日に受取通貨の想定元本金額が引渡通貨の想定元本金額と交換されます。
- (3) 受取想定元本金額または引渡想定元本金額は、通貨スワップの効力発生日に基づき、将来のある時点で決定および交換されることがあります。
- (4) この金融商品には、先渡取引の効力発生日があります。
- (5) ネットエクスポージャーは、デフォルト時に契約先から支払われる未収金、あるいは契約先に支払う未払金の純額を表します。店頭金融デリバティブ商品からのエクスポージャーは、同一の法人との同一の基本契約書の規定に基づく取引間でのみ相殺することができます。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第19期 (決算日 2022年2月14日)

(計算期間 2021年2月16日～2022年2月14日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第19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3日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債券組入 比率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率				
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	—	百万円 355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	292,112
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	222,859
18期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	—	273,346
19期 (2022年2月14日)	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	—	—	553,303

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

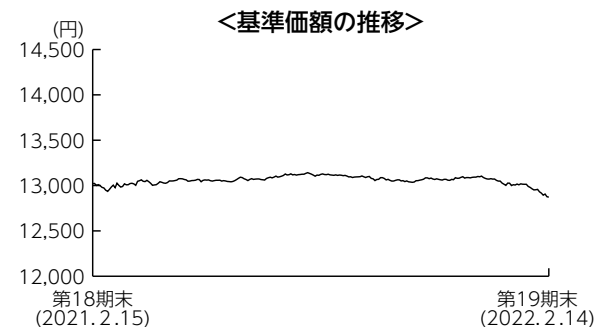
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2021年 2月15日	円 13,022	% -	ポイント 385.59	% -	% 99.2	% -	% -
2 月 末	12,936	△0.7	383.06	△0.7	99.5	-	-
3 月 末	13,025	0.0	385.72	0.0	99.7	-	-
4 月 末	13,049	0.2	386.44	0.2	99.8	-	-
5 月 末	13,054	0.2	386.62	0.3	99.9	-	-
6 月 末	13,061	0.3	386.90	0.3	99.8	-	-
7 月 末	13,125	0.8	388.81	0.8	99.7	-	-
8 月 末	13,114	0.7	388.46	0.7	99.4	-	-
9 月 末	13,069	0.4	387.12	0.4	105.3	-	-
10 月 末	13,054	0.2	386.72	0.3	100.2	-	-
11 月 末	13,086	0.5	387.65	0.5	99.6	-	-
12 月 末	13,057	0.3	386.84	0.3	100.4	-	-
2022年 1 月 末	12,964	△0.4	384.06	△0.4	99.3	-	-
(期 末) 2022年 2月14日	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月16日から2022年2月14日まで）

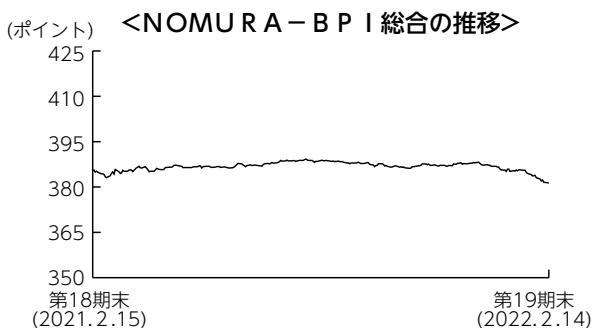


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,872円となり、前期末比で1.2%下落しました。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初は株式市場の上昇などを受けて基準価額は下落しました。2021年3月から8月にかけては新型コロナウイルスの感染収束が見通せず、国内景気の先行き不透明感が意識され基準価額は上昇しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手すると観測が広がり基準価額は下落しました。



投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初は株式市場の上昇などを受けて利回りは上昇しました。2021年3月から8月にかけては新型コロナウイルスの感染収束が見通せず、国内景気の先行き不透明感が意識され利回りは低下（価格

は上昇）しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手すると観測が広がり利回りは上昇しました。

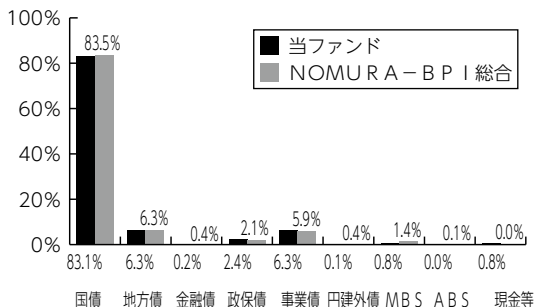
ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

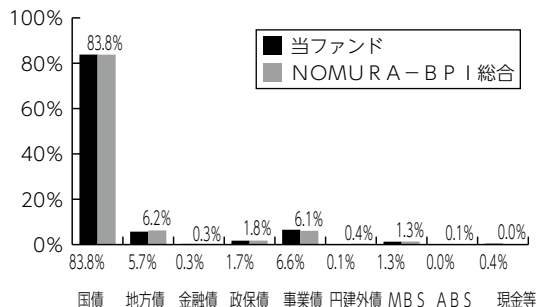
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

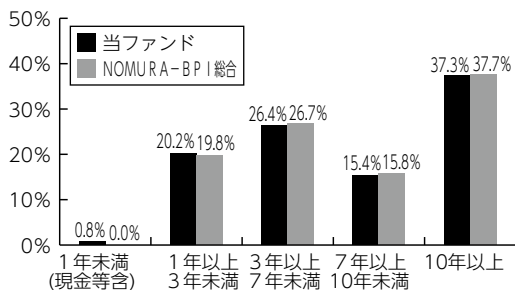


期末

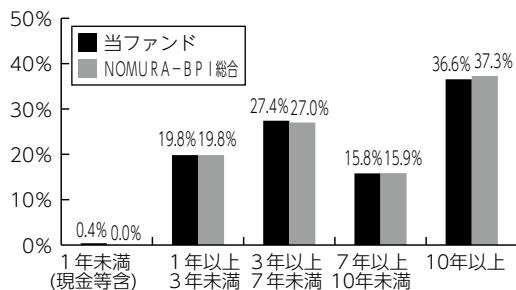


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で1.1%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、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、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

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2021年2月16日から2022年2月14日まで)

公社債

		買付額	売付額
国 内		千円	千円
	国債証券	717,343,530	471,488,133 (-)
	地方債証券	18,975,569	4,218,721 (-)
	特殊債証券	14,592,716	2,073,694 (297,842)
	社債証券	19,760,179	2,338,632 (-)

(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。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年2月16日から2022年2月14日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	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
公 社 債	百万円 770,671	百万円 100,563	% 13.0	百万円 480,119	百万円 73,234	% 15.3

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
公 社 債	百万円 304

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、みずほ証券です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内 (邦貨建) 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		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	447,045,000	463,797,306	83.8	—	53.6	19.7	10.5
地 方 債 証 券	30,445,330	31,523,404	5.7	4.7	3.6	1.4	0.7
特 殊 債 券	25,151,985	26,325,307	4.8	0.0	3.3	0.8	0.6
金 融 債 券	1,800,000	1,796,652	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 券	27,481,000	27,644,946	5.0	0.1	2.4	1.9	0.7
合 計	531,923,315	551,087,616	99.6	4.8	63.0	24.2	12.5

(注1) 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。

(注2) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内 (邦貨建) 公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
4 2 3 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,000,000	3,002,670	2023/04/01
4 2 4 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,100,000	3,102,976	2023/05/01
4 2 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,060	2023/06/01
1 3 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,850,000	4,861,058	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	8,350,000	8,447,027	2023/06/20
4 2 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,100,000	2,102,163	2023/07/01
4 2 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,400,000	2,402,448	2023/08/01
4 2 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,500,000	2,502,500	2023/09/01
1 3 7 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,610,000	3,619,205	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	3,460,000	3,507,194	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,950,000	1,970,377	2023/09/20
6 4 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	30,000	30,936	2023/09/20
4 2 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,100	2023/10/01
4 3 0 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,040	2023/11/01
4 3 1 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	4,000,000	4,003,920	2023/12/01
1 3 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	5,000,000	5,013,800	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	3,880,000	3,926,172	2023/12/20
6 5 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	60,000	62,153	2023/12/20
4 3 2 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,400,000	3,403,162	2024/01/01
1 3 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,750,000	3,760,950	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	3,630,000	3,678,206	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	50,000	52,023	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,490,000	3,500,609	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	4,240,000	4,302,582	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	50,000	52,841	2024/06/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
7 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	40,000	42,086	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,610,000	3,621,227	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	4,700,000	4,763,403	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	460,000	485,313	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,530,000	3,541,543	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	2,100,000	2,130,765	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,010,000	3,036,969	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	380,000	401,724	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	40,000	42,400	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,200,000	3,210,880	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	6,030,000	6,106,400	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	180,000	191,710	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	74,121	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	42,478	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	5,400,000	5,418,954	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	6,510,000	6,598,080	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	265,830	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	53,333	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	96,300	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,350,000	4,365,616	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	4,410,000	4,473,371	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	400,000	428,676	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	150,540	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,900,000	3,914,235	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,820,000	3,863,280	2025/12/20

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	償還年月日
(特殊債券)		%	千円	千円
6 1 回	住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	2025/12/19
4 0 回	政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	2026/03/13
1 1 回	独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	2026/03/20
1 8 7 回	住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	2026/04/20
8 3 回	地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	2026/04/28
8 0 回	住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	2026/09/18
3 2 1 回	住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	2026/09/18
7 9 回	政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	2026/11/06
9 1 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	2026/12/14
3 0 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	2027/01/29
F 1 4 7 回	地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	2027/03/19
7 8 回	日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	2027/04/13
3 0 9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	2027/04/30
7 2 回	東日本高速道路社債	0.1200	200,000	2027/06/18
9 8 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	2027/07/16
2 2 2 回	住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	2027/11/19
1 0 3 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	2027/12/17
1 2 4 回	住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	2027/12/20
7 7 回	東日本高速道路社債	0.1100	300,000	2027/12/20
2 3 0 回	住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	2028/02/18
1 1 3 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	2028/10/16
9 回	新関西国際空港社債	1.2310	200,000	2028/12/20
1 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	2028/12/20
9 3 回	都市再生債券	1.1020	100,000	2029/06/20
1 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	2029/06/28
2 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	2029/08/28
1 2 回	新関西国際空港社債	1.0670	200,000	2029/09/20
3 9 回	住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	2029/09/20
9 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	2029/12/28
7 8 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	2030/05/28
1 0 9 回	都市再生機構債券	0.9180	200,000	2030/06/20
1 5 回	日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	2030/10/29
1 2 1 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	2030/10/31
1 3 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	2031/01/28
9 0 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	2031/05/30
7 5 回	住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	2031/06/13
7 5 回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	2031/09/19
1 5 3 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	2031/12/26
1 9 回	地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	2031/12/26
2 3 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	2032/07/28
1 1 5 回	住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	2032/09/14
1 5 回	国際協力機構債券	1.7240	100,000	2032/09/17
2 4 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	2032/09/28
1 8 8 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	2033/04/28
2 8 回	日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	2033/12/20
1 2 4 回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	2034/03/17
3 6 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	2034/04/28
2 3 9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	2035/02/28
1 5 9 回	住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	2035/05/18
1 5 5 回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	2035/06/20

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	償還年月日
(特殊債券)		%	千円	千円
4 4 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	2023/06/28
2 5 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	2035/06/29
1 7 2 回	高速道路機構債	0.2880	200,000	2036/06/20
5 9 回	地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	2037/04/28
6 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	29,607	2037/05/10
8 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	20,706	2037/05/10
9 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	31,623	2037/05/10
3 1 9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	2037/07/31
2 6 回	高速道路機構債	2.6700	200,000	2037/09/18
2 回	貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	2.2700	33,411	2037/11/10
3 3 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	2038/01/29
2 3 3 回	住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	2038/04/20
2 1 0 回	高速道路機構債	0.6770	100,000	2038/09/17
2 8 8 回	政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	2040/07/27
1 1 6 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	2040/08/31
4 0 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	50,096	2041/03/10
4 3 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	11,209	2041/06/10
4 4 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	53,795	2041/07/10
5 1 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	32,226	2042/02/10
1 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	53,085	2042/05/10
4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	10,979	2042/08/10
1 4 8 回	住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	2043/12/18
2 7 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	18,671	2044/08/10
2 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	112,585	2044/10/10
3 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	173,976	2045/05/10
1 5 9 回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	2045/06/20
3 8 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	24,221	2045/07/10
2 6 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	2045/10/31
1 6 9 回	高速道路機構債	1.2000	100,000	2045/12/20
2 6 8 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	2046/01/31
4 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	21,048	2046/06/10
5 2 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	25,107	2046/09/10
5 3 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	26,331	2046/10/10
1 9 回	高速道路機構債	2.7500	150,000	2047/03/20
6 0 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	35,764	2047/05/10
6 4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	80,552	2047/09/10
7 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	34,953	2048/09/10
8 2 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,074	2049/03/10
8 4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	41,755	2049/05/10
8 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	45,545	2049/07/10
9 0 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	47,705	2049/11/10
9 3 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	52,914	2050/02/10
9 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	59,393	2050/05/10
1 3 1 回	日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	2050/06/20
1 6 5 回	都市再生機構債券	0.7090	200,000	2050/06/20
9 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	61,621	2050/08/10
4 1 8 回	高速道路機構債	0.6300	200,000	2051/08/31
4 2 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	2051/10/31
1 1 4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	228,276	2051/11/10
1 1 7 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,473	2052/02/10

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
3 4 回 西日本高速道路債	0.3350	200,000	201,988	2027/02/16
1 2 回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	109,385	2027/03/15
8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	110,997	2027/04/20
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	302,142	2027/04/23
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	301,983	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,320	2027/05/07
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	299,919	2027/07/16
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	111,110	2027/09/17
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	102,875	2027/09/24
<small>25回 フランス信託証券(銀行 8F C M 元社債 12/017)</small>	0.5100	300,000	300,165	2027/10/12
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,776	2027/10/22
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	198,714	2027/10/25
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	100,062	2027/11/19
17回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	300,276	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	301,581	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	396,368	2028/06/02
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	200,934	2028/06/06
<small>5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債</small>	0.4940	100,000	100,028	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	113,448	2029/03/21
<small>23回 三井住友ファイナンス&リース社債</small>	0.3900	100,000	99,654	2029/04/12
1 4 回 プリヂストン社債	0.3750	300,000	299,688	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	106,046	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	398,716	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	397,692	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	197,242	2029/07/25
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	197,254	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	114,048	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	199,608	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	99,336	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	99,442	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	198,552	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	400,636	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	99,435	2030/06/25
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	198,448	2030/08/09
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	399,996	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	113,148	2030/09/27
1 7 回 ダイセル社債	0.5000	300,000	300,510	2030/12/13

銘柄	当	期 末			
		利率	額面金額	評価額 償還年月日	
(普通社債券)	%	千円	千円		
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	297,459	2030/12/20	
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	230,196	2030/12/20	
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	198,218	2030/12/24	
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	201,078	2031/01/31	
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	98,948	2031/04/22	
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	296,484	2031/04/25	
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	296,946	2031/09/19	
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	493,755	2031/10/14	
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	197,668	2031/10/20	
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	201,890	2032/01/23	
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	99,513	2036/06/02	
<small>23回 三菱ケミカルホールディングス社債</small>	0.8500	200,000	202,224	2036/06/09	
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	197,974	2036/11/28	
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	101,283	2037/10/23	
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	99,688	2038/01/26	
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	100,776	2038/03/05	
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	198,848	2038/03/25	
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	100,101	2038/05/25	
8回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	200,640	2038/06/04	
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	97,663	2038/07/12	
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	98,977	2038/07/23	
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	95,902	2039/05/23	
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	193,860	2039/06/20	
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	92,270	2039/09/13	
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	94,387	2040/01/27	
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	193,374	2041/04/15	
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	192,742	2041/04/22	
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	96,298	2041/04/25	
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	109,475	2045/01/27	
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	103,649	2047/07/26	
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	93,961	2049/12/24	
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	189,550	2051/07/14	
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	93,754	2059/12/24	
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	91,698	2060/09/17	
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	93,516	2060/12/17	
小	計	-	27,481,000	27,644,946	-
合	計	-	531,923,315	551,087,616	-

■投資信託財産の構成

2022年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
コーポレートローン等、その他	551,087,616	91.6
投資信託財産総額	50,748,215	8.4
	601,835,832	100.0

(注) 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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月14日)現在

項目	当期末
(A) 資産	601,835,832,511円
コ ー ル ・ ン 等	49,696,366,967
公 社 債(評価額)	551,087,616,706
未 収 利 息	809,631,617
前 払 費	242,217,221
(B) 負債	48,532,656,000
未 払 解 約 債 金	48,532,656,000
(C) 純資産総額(A-B)	553,303,176,511
元 本	429,840,166,151
次 期 繰 越 損 益	123,463,010,360
(D) 受益権総口数	429,840,166,151口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,872円

(注1) 期首元本額	209,919,027,595円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	37,377,953円
追加設定元本額	611,239,283,321円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	15,418,280円
一部解約元本額	391,318,144,765円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	12,877,158円
(注2) 期末における元本の内訳		4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	327,852,051円
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,682,506,030円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	851,076円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	83,095,931円	DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
MITO ラップ型ファンド(中立的)	153,860,446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)	1,570,192,380円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	119,506,919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)	1,607,821,940円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	687,384,295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)	1,368,128,834円
グローバル8資産ラップファンド(中立的)	133,587,952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)	982,094,880円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,730,893円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	1,551,466,786円
たわらノーロード 国内債券	15,834,399,947円	インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定)	2,239,773,338円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,521,507,162円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型) 21-06	1,216,964,056円
たわらノーロード バランス (堅実型)	886,604,365円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	1,398,783,514円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,507,222,733円	DIAM国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	8,901,727,961円
たわらノーロード バランス (積極型)	189,908,936円	Oneコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	463,351,202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)	74,774,735円	投資のソムリエ・私費 (適格機関投資家限定)	2,068,944,514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)	1,322,091,006円	Oneコアポートフォリオ・プラス戦略 (債券動的アロケーション)	379,250,637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)	1,225,069,364円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	276,996,912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)	327,185,576円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	3,244,504,751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)	22,506,242円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家限定)	3,251,938,545円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	17,145,320円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定)	3,223,328,742円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	13,611,444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)	2,685,868,185円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	90,707,115円	リスクコントロール世界8資産(バランスファンド)(FoF用) (適格機関投資家専用)	51,300,165円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,060,786円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	165,802,939円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	414,272円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	98,585,137円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,277,651,015円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	27,788,034円
Oneグローバルバランス	8,911,633円	DIAM国際分散バランスファンドK50VA (適格機関投資家限定)	97,096,530円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,982,923,753円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	34,365,367円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	12,483,500,015円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,318,042円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,178,995,984円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	25,972,068円
DIAM DCバランス30インデックスファンド	2,189,166,701円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	126,573,725円
DIAM DCバランス50インデックスファンド	2,329,357,704円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	3,587,635,563円
DIAM DCバランス70インデックスファンド	390,282,840円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,301,884,615円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	87,660,620円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,374,149,034円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	3,040,981,442円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	113,717,347円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	11,707,847円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	190,263,848円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,303,883,102円	DIAM アクア グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,187,734,764円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,576,117,456円	DIAM世界アセット(バランスファンド)VA (適格機関投資家向け)	180,904,488円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	340,130,669円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	10,231,460円
投資のソムリエ	86,470,476,048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)	2,254,611,473円
クルーズコントロール	331,216,116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)	49,059,889円
投資のソムリエ<DC年金>	5,215,918,149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)	354,407,860円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,612,393,810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)	558,346,963円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	738,611,977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)	950,183,773円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,459,012円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	298,351,041円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,619,684円	DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	101,646,068円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,424,858,123円	Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	1,043,766,370円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	44,101,884,740円	コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	382,409,178円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	35,684,515円	動的パッケージファンド<DC年金>	333,573,020円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	17,735,957円	コア資産形成ファンド	227,460,602円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	53,072,038円	MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	42,573,117,520円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	176,635,602円	MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	46,106,741,798円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,233,253,084円	MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	14,232,766,343円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,448,159,838円	MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	1,641,455,600円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,330,495,531円	期末元本合計	429,840,166,151円

■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月14日

項	目	当	期
(A)	配 当 等 収 益	2,936,984,033	円
	受 取 利 息	2,933,836,057	
	そ の 他 収 益	4,106,122	
	支 払 利 息	△958,146	
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益	△10,450,257,321	
	売 買 益	660,402,300	
	売 買 損	△11,110,659,621	
(C)	当 期 損 益 金(A+B)	△7,513,273,288	
(D)	前 期 繰 越 損 益 金	63,427,095,992	
(E)	解 約 差 損 益 金	△119,188,902,023	
(F)	追 加 信 託 差 損 益 金	186,738,089,679	
(G)	計(C+D+E+F)	123,463,010,360	
	次 期 繰 越 損 益 金(G)	123,463,010,360	

(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) (E)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) (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。