

償還 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	追加型投信／海外／債券
信託期間	2008年3月28日から2022年12月8日(当初無期限)までです。
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」(JPY) 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172期	<決算日	2022年8月12日>
第173期	<決算日	2022年9月12日>
第174期	<決算日	2022年10月12日>
第175期	<決算日	2022年11月14日>
第176期	<償還日	2022年12月8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、この度、信託約款の規定に基づき、繰上償還の運びとなりました。

ここに、運用経過と償還内容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

■設定以来の運用実績

作成期	決算期	基準価額			JPMorganGBI-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)		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1作成期	(設定日) 2008年3月28日	円	円	%	ポイント (3月27日) 178.72	%	%	%	%	百万円
	1期(2008年5月12日)	10,000	-	-	186.91	4.6	98.8	0.3	-	3,195
	2期(2008年6月12日)	10,423	0	1.4	189.37	1.3	98.9	0.2	-	4,913
	3期(2008年7月14日)	10,625	70	2.6	195.92	3.5	99.2	0.2	-	6,548
第2作成期	4期(2008年8月12日)	10,857	200	4.1	204.73	4.5	99.4	0.1	-	10,015
	5期(2008年9月12日)	9,789	70	△9.2	185.73	△9.3	99.2	0.1	-	13,905
	6期(2008年10月14日)	8,357	70	△13.9	160.63	△13.5	99.4	0.1	-	12,972
	7期(2008年11月12日)	7,493	70	△9.5	144.75	△9.9	99.2	0.1	-	11,826
	8期(2008年12月12日)	7,496	70	1.0	146.61	1.3	99.1	0.1	-	11,903
第3作成期	9期(2009年1月13日)	7,403	70	△0.3	144.46	△1.5	99.1	0.1	-	11,635
	10期(2009年2月12日)	7,059	70	△3.7	139.19	△3.6	99.2	0.1	-	11,137
	11期(2009年3月12日)	7,328	70	4.8	145.70	4.7	99.2	0.1	-	11,691
	12期(2009年4月13日)	8,290	70	14.1	166.67	14.4	99.1	0.1	-	13,489
	13期(2009年5月12日)	8,427	70	2.5	171.15	2.7	99.2	0.1	-	14,042
	14期(2009年6月12日)	8,497	70	1.7	175.35	2.5	99.3	0.1	-	14,803
	15期(2009年7月13日)	7,975	70	△5.3	166.29	△5.2	99.4	0.1	-	14,987
第4作成期	16期(2009年8月12日)	8,529	70	7.8	180.12	8.3	99.4	0.1	-	16,968
	17期(2009年9月14日)	8,260	70	△2.3	176.41	△2.1	99.2	0.1	-	18,116
	18期(2009年10月13日)	8,378	70	2.3	181.18	2.7	99.6	0.1	-	19,742
	19期(2009年11月12日)	8,382	70	0.9	183.51	1.3	99.2	0.0	-	20,873
	20期(2009年12月14日)	8,229	70	△1.0	181.72	△1.0	99.4	0.0	-	21,104
第5作成期	21期(2010年1月12日)	8,589	70	5.2	191.85	5.6	99.4	0.0	-	22,349
	22期(2010年2月12日)	8,085	70	△5.1	181.39	△5.5	99.4	0.0	-	21,352
	23期(2010年3月12日)	8,383	70	4.6	189.89	4.7	99.4	0.0	-	21,824
	24期(2010年4月12日)	8,823	70	6.1	201.88	6.3	99.4	0.0	-	22,588
	25期(2010年5月12日)	8,514	70	△2.7	194.69	△3.6	99.3	0.0	-	21,288
	26期(2010年6月14日)	8,281	70	△1.9	190.15	△2.3	99.4	0.1	-	20,662
	27期(2010年7月12日)	8,153	70	△0.7	189.91	△0.1	99.4	0.1	-	20,103
第6作成期	28期(2010年8月12日)	8,013	70	△0.9	189.08	△0.4	99.5	0.1	-	19,650
	29期(2010年9月13日)	8,011	70	0.8	190.70	0.9	99.4	0.1	-	19,375
	30期(2010年10月12日)	8,141	70	2.5	196.92	3.3	99.2	0.1	-	19,357
	31期(2010年11月12日)	8,054	70	△0.2	195.56	△0.7	99.1	0.1	-	19,113
	32期(2010年12月13日)	7,874	70	△1.4	193.44	△1.1	99.2	0.1	-	18,565
	33期(2011年1月12日)	7,786	70	△0.2	192.68	△0.4	98.9	0.1	-	18,082

作成期	決算期	基準価額			JPMorganGBI-EEM グローバル・ディバシファイド (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7作成期	34期(2011年2月14日)	円 7,608	円 70	% △1.4	ポイント 192.83	% 0.1	% 99.2	% 0.1	% -	百万円 17,472
	35期(2011年3月14日)	7,528	70	△0.1	192.75	△0.0	99.0	0.1	-	16,798
	36期(2011年4月12日)	8,072	70	8.2	209.38	8.6	99.3	0.1	-	17,741
	37期(2011年5月12日)	7,722	70	△3.5	201.42	△3.8	99.2	0.1	-	16,767
	38期(2011年6月13日)	7,576	70	△1.0	200.81	△0.3	99.1	0.1	-	16,002
	39期(2011年7月12日)	7,501	70	△0.1	200.42	△0.2	99.2	0.1	-	15,402
第8作成期	40期(2011年8月12日)	7,067	70	△4.9	189.84	△5.3	98.9	0.1	-	14,157
	41期(2011年9月12日)	7,121	70	1.8	192.69	1.5	98.9	0.1	-	14,135
	42期(2011年10月12日)	6,618	70	△6.1	180.93	△6.1	99.1	0.1	-	12,929
	43期(2011年11月14日)	6,703	70	2.3	183.99	1.7	99.0	0.1	-	12,932
	44期(2011年12月12日)	6,520	70	△1.7	181.53	△1.3	99.2	0.1	-	12,365
第9作成期	45期(2012年1月12日)	6,341	70	△1.7	178.30	△1.8	99.2	0.1	-	11,869
	46期(2012年2月13日)	6,788	70	8.2	194.30	9.0	99.3	0.1	-	12,438
	47期(2012年3月12日)	7,174	70	6.7	207.61	6.9	99.4	0.1	-	12,921
	48期(2012年4月12日)	6,839	70	△3.7	200.15	△3.6	99.2	0.1	-	12,166
	49期(2012年5月14日)	6,641	70	△1.9	196.73	△1.7	99.4	0.1	-	11,733
	50期(2012年6月12日)	6,342	70	△3.4	189.60	△3.6	99.2	0.1	-	11,133
第10作成期	51期(2012年7月12日)	6,482	70	3.3	196.56	3.7	99.3	0.1	-	11,240
	52期(2012年8月13日)	6,443	70	0.5	198.59	1.0	99.2	0.1	-	11,055
	53期(2012年9月12日)	6,404	70	0.5	199.81	0.6	99.0	0.1	-	9,837
	54期(2012年10月12日)	6,443	50	1.4	202.79	1.5	99.2	0.1	-	9,248
	55期(2012年11月12日)	6,468	50	1.2	206.15	1.7	99.2	0.1	-	8,625
	56期(2012年12月12日)	6,803	50	6.0	219.42	6.4	99.2	0.1	-	8,379
	57期(2013年1月15日)	7,450	50	10.2	241.47	10.0	99.2	0.1	-	8,471
第11作成期	58期(2013年2月12日)	7,737	50	4.5	253.34	4.9	99.2	0.1	-	8,214
	59期(2013年3月12日)	7,881	50	2.5	259.13	2.3	99.2	0.1	-	7,660
	60期(2013年4月12日)	8,295	50	5.9	275.32	6.2	99.2	0.1	-	7,538
	61期(2013年5月13日)	8,424	50	2.2	282.29	2.5	99.1	0.2	-	7,242
	62期(2013年6月12日)	7,228	50	△13.6	245.40	△13.1	99.0	0.2	-	5,949
	63期(2013年7月12日)	7,137	50	△0.6	245.70	0.1	99.1	0.2	-	5,760
第12作成期	64期(2013年8月12日)	6,993	50	△1.3	242.97	△1.1	99.0	0.2	-	5,507
	65期(2013年9月12日)	6,905	50	△0.5	243.07	0.0	99.2	0.2	-	5,246
	66期(2013年10月15日)	7,004	50	2.2	248.54	2.3	99.1	0.2	-	5,190
	67期(2013年11月12日)	6,793	50	△2.3	244.20	△1.7	99.1	0.2	-	4,886
	68期(2013年12月12日)	6,982	50	3.5	253.12	3.7	98.5	0.2	-	4,795
第13作成期	69期(2014年1月14日)	6,909	50	△0.3	252.69	△0.2	98.5	0.2	-	4,547
	70期(2014年2月12日)	6,595	50	△3.8	243.79	△3.5	98.4	0.3	-	4,205
	71期(2014年3月12日)	6,695	50	2.3	249.48	2.3	98.4	0.3	-	4,182
	72期(2014年4月14日)	6,822	50	2.6	256.66	2.9	98.3	0.3	-	4,160
	73期(2014年5月12日)	6,857	50	1.2	259.64	1.2	98.4	0.3	-	4,103
	74期(2014年6月12日)	6,873	50	1.0	262.29	1.0	98.5	0.3	-	4,021
	75期(2014年7月14日)	6,842	50	0.3	263.61	0.5	98.6	0.3	-	3,898

作成期	決算期	基準価額			JPMORGANGBI-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)		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14作成期	76期(2014年8月12日)	円 6,729	円 50	% △0.9	ポイント 261.30	% △0.9	% 98.7	% 0.3	% -	百万円 3,753
	77期(2014年9月12日)	6,904	50	3.3	270.53	3.5	97.9	0.3	-	3,802
	78期(2014年10月14日)	6,728	50	△1.8	266.74	△1.4	98.6	0.3	-	3,630
	79期(2014年11月12日)	7,006	50	4.9	281.99	5.7	98.3	0.3	-	3,713
	80期(2014年12月12日)	6,851	50	△1.5	278.54	△1.2	98.3	0.3	-	3,548
	81期(2015年1月13日)	6,698	50	△1.5	274.55	△1.4	97.7	0.3	-	3,413
第15作成期	82期(2015年2月12日)	6,542	50	△1.6	271.93	△1.0	97.6	0.3	-	3,300
	83期(2015年3月12日)	6,300	50	△2.9	263.39	△3.1	97.9	0.4	-	3,110
	84期(2015年4月13日)	6,431	50	2.9	272.27	3.4	98.1	0.4	-	3,099
	85期(2015年5月12日)	6,326	50	△0.9	270.56	△0.6	98.4	0.4	-	3,002
	86期(2015年6月12日)	6,263	50	△0.2	271.13	0.2	98.4	0.4	-	2,940
	87期(2015年7月13日)	6,151	50	△1.0	268.68	△0.9	97.6	0.4	-	2,822
第16作成期	88期(2015年8月12日)	5,904	50	△3.2	261.36	△2.7	97.9	0.4	-	2,668
	89期(2015年9月14日)	5,293	50	△9.5	238.43	△8.8	98.3	0.5	-	2,347
	90期(2015年10月13日)	5,461	50	4.1	250.44	5.0	98.4	0.5	-	2,419
	91期(2015年11月12日)	5,408	50	△0.1	249.82	△0.2	97.9	0.5	-	2,349
	92期(2015年12月14日)	4,991	50	△6.8	234.45	△6.2	98.2	0.5	-	2,155
	93期(2016年1月12日)	4,732	50	△4.2	224.68	△4.2	95.3	0.6	-	2,004
第17作成期	94期(2016年2月12日)	4,588	50	△2.0	222.20	△1.1	95.7	0.6	-	1,929
	95期(2016年3月14日)	4,858	50	7.0	239.19	7.6	96.4	0.6	-	2,028
	96期(2016年4月12日)	4,741	50	△1.4	235.45	△1.6	97.1	0.6	-	1,960
	97期(2016年5月12日)	4,725	50	0.7	236.12	0.3	96.7	0.6	-	1,935
	98期(2016年6月13日)	4,620	50	△1.2	233.39	△1.2	96.2	0.7	-	1,875
	99期(2016年7月12日)	4,525	50	△1.0	230.97	△1.0	96.4	0.7	-	1,838
第18作成期	100期(2016年8月12日)	4,528	50	1.2	234.42	1.5	97.0	0.7	-	1,804
	101期(2016年9月12日)	4,466	50	△0.3	234.00	△0.2	97.2	0.7	-	1,771
	102期(2016年10月12日)	4,453	50	0.8	235.41	0.6	96.5	0.7	-	1,755
	103期(2016年11月14日)	4,198	50	△4.6	227.03	△3.6	96.8	0.7	-	1,644
	104期(2016年12月12日)	4,511	50	8.6	246.90	8.8	96.5	0.7	-	1,749
	105期(2017年1月12日)	4,499	50	0.8	248.86	0.8	94.9	0.7	-	1,726
第19作成期	106期(2017年2月13日)	4,552	50	2.3	253.63	1.9	96.8	0.7	-	1,762
	107期(2017年3月13日)	4,550	50	1.1	256.56	1.2	96.2	0.7	-	1,749
	108期(2017年4月12日)	4,419	50	△1.8	250.89	△2.2	96.5	0.7	-	1,687
	109期(2017年5月12日)	4,597	50	5.2	264.59	5.5	97.2	0.7	-	1,741
	110期(2017年6月12日)	4,529	50	△0.4	264.63	0.0	96.9	0.7	-	1,716
	111期(2017年7月12日)	4,564	50	1.9	269.98	2.0	96.9	0.7	-	1,725
第20作成期	112期(2017年8月14日)	4,421	50	△2.0	264.64	△2.0	97.0	0.7	-	1,663
	113期(2017年9月12日)	4,529	50	3.6	274.19	3.6	96.2	0.7	-	1,695
	114期(2017年10月12日)	4,473	50	△0.1	274.73	0.2	96.3	0.7	-	1,669
	115期(2017年11月13日)	4,371	50	△1.2	271.08	△1.3	96.6	0.7	-	1,598
	116期(2017年12月12日)	4,389	50	1.6	275.95	1.8	96.6	0.8	-	1,598
	117期(2018年1月12日)	4,444	50	2.4	281.95	2.2	96.3	0.8	-	1,603

作成期	決算期	基準価額			JPMorganGBI-EM グローバル・ディバシファイド (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21作成期	118期(2018年2月13日)	円 4,314	円 50	% △1.8	ポイント 276.55	% △1.9	% 95.9	% 0.8	% -	百万円 1,558
	119期(2018年3月12日)	4,275	50	0.3	275.82	△0.3	96.3	0.8	-	1,585
	120期(2018年4月12日)	4,189	50	△0.8	274.25	△0.6	96.1	0.8	-	1,583
	121期(2018年5月14日)	4,055	50	△2.0	270.02	△1.5	96.1	0.8	-	1,544
	122期(2018年6月12日)	3,852	50	△3.8	261.51	△3.2	95.9	0.9	-	1,419
第22作成期	123期(2018年7月12日)	3,819	50	0.4	261.63	0.0	96.0	0.8	-	1,432
	124期(2018年8月13日)	3,633	50	△3.6	251.83	△3.7	95.8	0.9	-	1,409
	125期(2018年9月12日)	3,465	50	△3.2	243.94	△3.1	96.5	0.9	-	1,333
	126期(2018年10月12日)	3,543	50	3.7	252.78	3.6	95.7	0.9	-	1,370
	127期(2018年11月12日)	3,595	25	2.2	258.18	2.1	96.0	0.9	-	1,392
	128期(2018年12月12日)	3,593	25	0.6	259.03	0.3	96.3	0.9	-	1,365
第23作成期	129期(2019年1月15日)	3,572	25	0.1	259.12	0.0	94.1	0.9	-	1,348
	130期(2019年2月12日)	3,660	25	3.2	266.76	2.9	96.5	0.9	-	1,370
	131期(2019年3月12日)	3,657	25	0.6	267.28	0.2	95.6	1.0	-	1,221
	132期(2019年4月12日)	3,713	25	2.2	271.85	1.7	96.0	1.0	-	1,247
	133期(2019年5月13日)	3,561	25	△3.4	262.01	△3.6	96.0	1.1	-	1,166
	134期(2019年6月12日)	3,628	25	2.6	267.58	2.1	96.6	1.1	-	1,177
第24作成期	135期(2019年7月12日)	3,747	25	4.0	276.76	3.4	96.1	1.0	-	1,200
	136期(2019年8月13日)	3,562	25	△4.3	264.64	△4.4	95.6	1.1	-	1,140
	137期(2019年9月12日)	3,595	25	1.6	271.72	2.7	95.5	1.1	-	1,149
	138期(2019年10月15日)	3,640	25	1.9	276.95	1.9	95.9	1.1	-	1,147
	139期(2019年11月12日)	3,648	25	0.9	280.32	1.2	96.5	1.1	-	1,138
	140期(2019年12月12日)	3,627	25	0.1	280.31	△0.0	96.3	1.1	-	1,095
第25作成期	141期(2020年1月14日)	3,749	25	4.1	290.33	3.6	95.2	1.1	-	1,109
	142期(2020年2月12日)	3,700	25	△0.6	288.01	△0.8	96.2	1.2	-	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
第26作成期	147期(2020年7月13日)	3,338	15	△0.4	266.49	△0.4	95.6	1.3	-	931
	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
159期(2021年7月12日)	3,417	15	△2.7	286.42	△2.6	95.5	1.6	-	798	

作成期	決算期	基準価額			J.P.モルガンGBI-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28作成期	160期(2021年8月12日)	円 3,383	円 15	% △0.6	ポイント 285.54	% △0.3	% 95.6	% 1.6	% -	百万円 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
	165期(2022年1月12日)	3,308	15	1.6	284.99	1.8	95.7	1.7	-	735
第29作成期	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
第30作成期	172期(2022年8月12日)	3,333	15	2.1	290.56	2.5	95.6	1.7	-	708
	173期(2022年9月12日)	3,461	15	4.3	302.95	4.3	95.3	1.6	-	730
	174期(2022年10月12日)	3,323	15	△3.6	293.04	△3.3	95.2	1.7	-	701
	175期(2022年11月14日)	3,252	15	△1.7	293.33	0.1	96.1	1.9	-	632
	(償還日) 2022年12月8日	(償還価額) 3,277.73		0	0.8	296.36	1.0	-	-	-

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

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 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4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 「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6) J.P.モルガンGBI-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7) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基準価額		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)		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172期	(期首) 2022年7月12日	円 3,279	% -	ポイント 283.47	% -	% 95.3	% 1.7	% -
	7月末	3,271	△0.2	283.78	0.1	95.5	1.7	-
	(期末) 2022年8月12日	3,348	2.1	290.56	2.5	95.6	1.7	-
第173期	(期首) 2022年8月12日	3,333	-	290.56	-	95.6	1.7	-
	8月末	3,396	1.9	295.47	1.7	96.1	1.7	-
	(期末) 2022年9月12日	3,476	4.3	302.95	4.3	95.3	1.6	-
第174期	(期首) 2022年9月12日	3,461	-	302.95	-	95.3	1.6	-
	9月末	3,313	△4.3	290.22	△4.2	95.1	1.8	-
	(期末) 2022年10月12日	3,338	△3.6	293.04	△3.3	95.2	1.7	-
第175期	(期首) 2022年10月12日	3,323	-	293.04	-	95.2	1.7	-
	10月末	3,365	1.3	296.61	1.2	95.3	1.7	-
	(期末) 2022年11月14日	3,267	△1.7	293.33	0.1	96.1	1.9	-
第176期	(期首) 2022年11月14日	3,252	-	293.33	-	96.1	1.9	-
	11月末	3,278	0.8	295.99	0.9	18.0	-	-
	(償還日) 2022年12月8日	(償還価額) 3,277.73	0.8	296.36	1.0	-	-	-

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

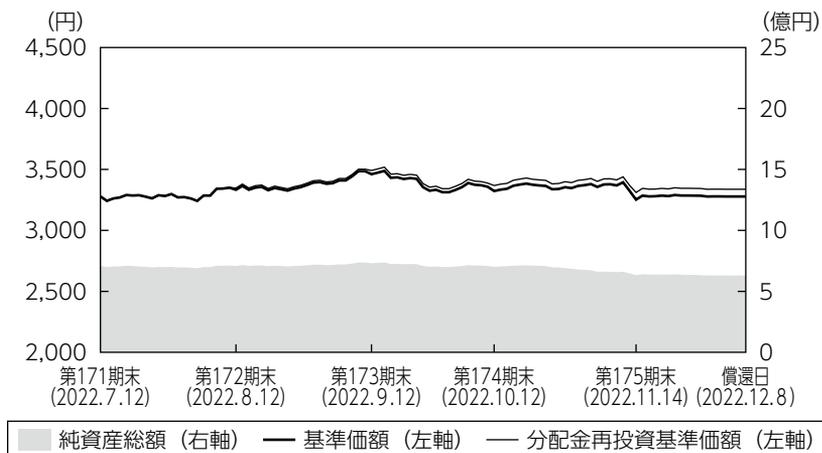
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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。

■設定以来の運用経過（2008年3月28日から2022年12月8日まで）

第30作成期の基準価額等の推移



第172期首： 3,279円
償還日： 3,277.73円
(既払分配金60円)
騰落率： 1.8%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (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

当作成期は、新興国債券市場が上昇したことに加え、新興国通貨が対円で上昇したため、基準価額は上昇しました。

設定来では、新興国通貨が対円で下落した一方、新興国債券市場が上昇したことなどから、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)	2.2%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.8%

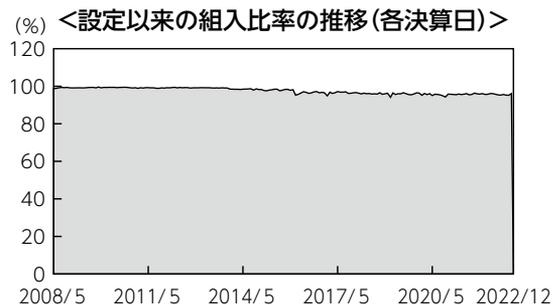
- (注1) ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンドJ (JPY) の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。
- (注2) 組入ファンドの騰落率は、当ファンドが保有していた期間 (ピムコ ケイマン エマージング ローカル ボンド ストラテジー ファンドJ (JPY) は2022年12月1日まで、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは2022年11月14日まで) の騰落率です。

設定来の投資環境

設定来、新興国債券市場（現地通貨ベース）は上昇しました。設定当初の2008年は、米サブプライムローン問題に端を発したリーマン・ブラザーズの経営破綻や欧州金融危機などを背景に信用不安が高まり下落しました。その後、主要国で大規模な財政金融政策が実施されたことなどから、市場のリスク選好姿勢が改善し、新興国債券市場も上昇に転じました。2015年から2016年にかけて原油価格が大幅に下落したことから、上昇幅を縮小する局面もありました。更に、2020年に入り、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大により主要都市で都市封鎖が実施されたことから一時的に上昇幅を大幅に縮小しました。しかし、新型コロナウイルスのワクチン開発や主要国での大規模な財政金融政策が再び実施されたことから、市場は回復に向かいました。2022年からは、F R B（米連邦準備理事会）など、世界の金融当局が金融引き締めめに政策転換したことやロシアによるウクライナ侵攻などの地政学リスクの高まりを受けて、上昇幅を縮小しましたが、設定来で市場は上昇して償還日を迎えました。国別では、全ての国がプラスリターンとなりました。

国内債券市場は上昇しました。設定当初から2008年9月にかけて、世界的な金融危機を受けて金利は上昇（価格は下落）しました。2008年9月から2016年半ばにかけては、日銀が次々と追加金融緩和政策を打ち出したことで金利は大幅に低下（価格は上昇）しました。2016年半ばから作成期末にかけては、長短金利操作付き量的質的金融緩和政策の導入などを受けて金利低下は一服しましたが、低水準で横ばい推移した結果、期を通じては金利は低下しました。

設定来、新興国の為替市場は下落しました。新興国通貨も新興国債券市場と同様に、2008年の世界的な金融危機により対円で大きく下落しました。その後、新興国における景気回復などがプラス要因となり回復する局面が見られたものの、2015年の原油価格の大幅下落、2020年の新型コロナウイルスの感染拡大、2022年のF R Bによる金融引き締め開始やロシアによるウクライナ侵攻など、マイナス要因が多く、設定来では対円で下落しました。通貨別で見ると、中国元やタイバーツなどが上昇した一方、アルゼンチンペソやトルコリラなどが下落しました。



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。



設定来の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)

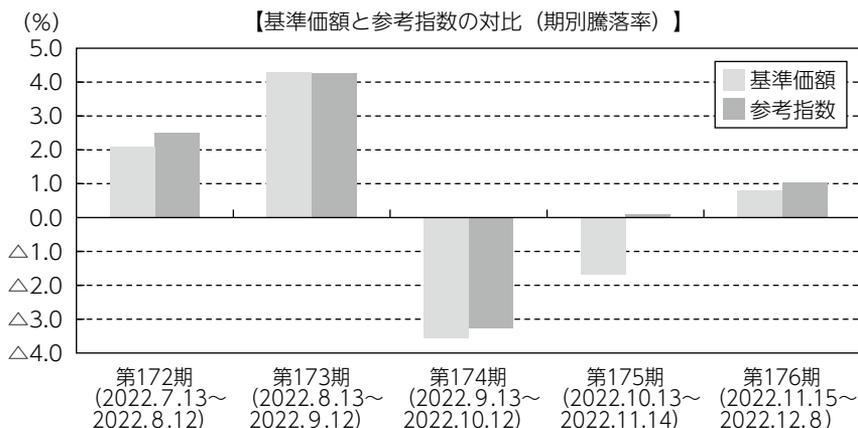
債券については、資源の産出による恩恵が期待でき、また中央銀行の信頼性が高いブラジルやファンダメンタルズの改善が期待できるペルーを積極姿勢とする一方で、中央銀行の信頼性が懸念されるトルコを消極姿勢としました。通貨については、投資妙味が相対的に高いと見ていたメキシコペソ、ブラジルリアルなどを積極姿勢とした一方で、地政学リスクや政情不安への懸念からハンガリーフォリントを消極姿勢としました。

●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-RBP I 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。

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-EMグローバル・ディバシファイド(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した。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第172期	第173期	第174期	第175期
	2022年7月13日 ～2022年8月12日	2022年8月13日 ～2022年9月12日	2022年9月13日 ～2022年10月12日	2022年10月13日 ～2022年11月14日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.45%	0.43%	0.45%	0.46%
当期の収益	15円	15円	15円	14円
当期の収益以外	-円	-円	-円	0円
翌期繰越分配対象額	2,341円	2,346円	2,346円	2,346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。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第172期～第176期 (2022年7月13日 ～2022年12月8日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	26円	
(投信会社)	(16)	(0.481)	
(販売会社)	(9)	(0.271)	
(受託会社)	(1)	(0.017)	
(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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(監査費用)	(0)	(0.000)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	26	0.770	

(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。

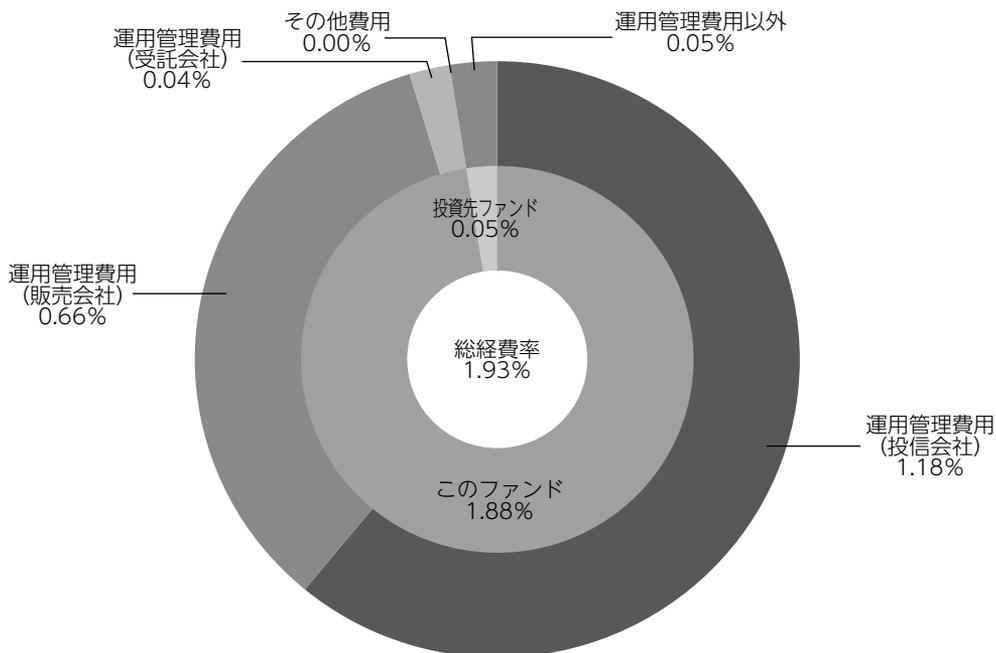
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.93%です。



総経費率 (①+②+③)	1.93%
①このファンドの費用の比率	1.88%
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	0.05%

(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7月13日から2022年12月8日まで)

投資信託受益証券

		第 172 期 ~ 第 176 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
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)	-	-	296.17538	675,586

(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7月13日から2022年12月8日まで)

		第 172 期 ~ 第 176 期			
		設 定		解 約	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド		-	-	9,450	11,884

■利害関係人との取引状況等 (2022年7月13日から2022年12月8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状況

決 算 期		第 172 期 ~ 第 176 期				
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	0.001	0.001	100.0	0.001	0.001	100.0

【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 172 期 ~ 第 176 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
公 社 債	520,188	29,925	5.8	476,769	26,705	5.6

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、みずほ信託銀行です。

■投資信託財産の構成

2022年12月8日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 630,886	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	630,886	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8月12日)、(2022年9月12日)、(2022年10月12日)、(2022年11月14日)、(2022年12月8日)現在

項 目	第 172 期 末	第 173 期 末	第 174 期 末	第 175 期 末	償 還 時
(A) 資 産	712,775,378円	735,863,429円	705,497,601円	638,648,552円	630,886,358円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	23,492,190	19,783,678	26,440,406	19,048,810	630,886,358
投資信託受益証券(評価額)	677,176,781	696,099,974	667,168,138	607,715,410	-
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	12,106,407	11,979,777	11,889,057	11,884,332	-
未 収 入 金	-	8,000,000	-	-	-
(B) 負 債	4,725,061	5,527,688	4,418,184	6,032,885	995,422
未 払 収 益 分 配 金	3,186,120	3,165,731	3,164,254	2,918,095	-
未 払 解 約 金	422,455	1,223,488	152,454	1,956,306	181,376
未 払 信 託 報 酬	1,114,751	1,136,700	1,099,760	1,158,484	812,438
未 払 利 息	-	-	-	-	1,608
そ の 他 未 払 費 用	1,735	1,769	1,716	-	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	708,050,317	730,335,741	701,079,417	632,615,667	629,890,936
元 本	2,124,080,085	2,110,487,367	2,109,502,867	1,945,396,793	1,921,731,082
次 期 繰 越 損 益 金	△1,416,029,768	△1,380,151,626	△1,408,423,450	△1,312,781,126	-
償 還 差 損 益 金	-	-	-	-	△1,291,840,146
(D) 受 益 権 総 口 数	2,124,080,085口	2,110,487,367口	2,109,502,867口	1,945,396,793口	1,921,731,082口
1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C/D)	3,333円	3,461円	3,323円	3,252円	-
1 万 口 当 ち 償 還 価 額 (C/D)	-	-	-	-	3,277円73銭

(注) 第171期末における元本額は2,157,225,568円、第172期～償還時における追加設定元本額は24,356,083円、同解約元本額は259,850,569円です。

■損益の状況

〔自 2022年7月13日 至 2022年8月12日〕〔自 2022年8月13日 至 2022年9月12日〕〔自 2022年9月13日 至 2022年10月12日〕〔自 2022年10月13日 至 2022年11月14日〕〔自 2022年11月15日 至 2022年12月8日〕

項 目	第 172 期	第 173 期	第 174 期	第 175 期	第 176 期
(A) 配 当 等 収 益	4,389,310円	4,383,592円	4,338,723円	4,033,351円	△27,529円
受 取 配 当 金	4,389,504	4,384,126	4,339,775	4,034,715	—
受 取 利 息	10	—	25	50	123
支 払 利 息	△204	△534	△1,077	△1,414	△27,652
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,540,891	26,728,059	△28,956,778	△13,890,020	5,810,070
売 買 益	11,558,449	26,923,450	58,636	568,656	5,829,718
売 買 損	△17,558	△195,391	△29,015,414	△14,458,676	△19,648
(C) 信 託 報 酬 等	△1,116,486	△1,138,469	△1,101,476	△1,158,484	△812,438
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	14,813,715	29,973,182	△25,719,531	△11,015,153	4,970,103
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△750,058,893	△732,145,604	△702,985,752	△673,281,193	△677,675,374
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△677,598,470	△674,813,473	△676,553,913	△625,566,685	△619,134,875
(配 当 等 相 当 額)	(233,918,859)	(232,978,453)	(233,622,070)	(216,036,992)	(213,821,479)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△911,517,329)	(△907,791,926)	(△910,175,983)	(△841,603,677)	(△832,956,354)
(G) 合 計(D+E+F)	△1,412,843,648	△1,376,985,895	△1,405,259,196	△1,309,863,031	△1,291,840,146
(H) 収 益 分 配 金	△3,186,120	△3,165,731	△3,164,254	△2,918,095	—
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△1,416,029,768	△1,380,151,626	△1,408,423,450	△1,312,781,126	—
追 加 信 託 差 損 益 金	△677,598,470	△674,813,473	△676,553,913	△625,566,685	—
(配 当 等 相 当 額)	(233,918,862)	(232,978,453)	(233,622,073)	(216,036,993)	(—)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△911,517,332)	(△907,791,926)	(△910,175,986)	(△841,603,678)	(—)
償 還 差 損 益 金	—	—	—	—	△1,291,840,146
分 配 準 備 積 立 金	263,331,325	262,153,344	261,357,561	240,397,891	—
繰 越 損 益 金	△1,001,762,623	△967,491,497	△993,227,098	△927,612,332	—

(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 172 期	第 173 期	第 174 期	第 175 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,087,875円	4,229,290円	3,242,792円	2,880,880円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	233,918,862	232,978,453	233,622,073	216,036,993
(d) 分 配 準 備 積 立 金	262,429,570	261,089,785	261,279,023	240,435,106
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	500,436,307	498,297,528	498,143,888	459,352,979
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	2,356.01	2,361.05	2,361.43	2,361.23
(g) 分 配 金	3,186,120	3,165,731	3,164,254	2,918,095
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	15	15	15	15

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 172 期	第 173 期	第 174 期	第 175 期
1 万口当たり分配金	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。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2008年3月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年12月8日		資産総額	630,886,358円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	995,422円
				純資産総額	629,890,936円
受益権口数	1,852,266,283口	1,921,731,082口	69,464,799口	受益権口数	1,921,731,082口
元本額	1,852,266,283円	1,921,731,082円	69,464,799円	1万口当たり償還金	3,277円73銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	3,109,557,079円	3,195,948,002円	10,278円	0円	0.00%
第2期	4,714,357,836	4,913,720,104	10,423	0	0.00
第3期	6,163,144,430	6,548,417,581	10,625	70	0.70
第4期	9,225,554,960	10,015,814,964	10,857	200	2.00
第5期	14,205,061,485	13,905,101,400	9,789	70	0.70
第6期	15,523,208,224	12,972,058,919	8,357	70	0.70
第7期	15,783,738,121	11,826,362,712	7,493	70	0.70
第8期	15,879,348,041	11,903,175,680	7,496	70	0.70
第9期	15,715,736,069	11,635,138,129	7,403	70	0.70
第10期	15,776,850,872	11,137,572,375	7,059	70	0.70
第11期	15,954,891,059	11,691,025,266	7,328	70	0.70
第12期	16,271,532,630	13,489,008,262	8,290	70	0.70
第13期	16,663,357,369	14,042,100,988	8,427	70	0.70
第14期	17,421,600,927	14,803,789,831	8,497	70	0.70
第15期	18,794,410,879	14,987,994,506	7,975	70	0.70
第16期	19,894,900,228	16,968,025,582	8,529	70	0.70
第17期	21,932,621,223	18,116,579,182	8,260	70	0.70
第18期	23,563,790,599	19,742,490,336	8,378	70	0.70
第19期	24,903,977,602	20,873,377,885	8,382	70	0.70
第20期	25,648,085,013	21,104,742,779	8,229	70	0.70
第21期	26,021,301,358	22,349,113,148	8,589	70	0.70
第22期	26,410,272,444	21,352,224,713	8,085	70	0.70
第23期	26,034,063,900	21,824,195,992	8,383	70	0.70
第24期	25,603,083,212	22,588,720,732	8,823	70	0.70
第25期	25,004,183,200	21,288,922,106	8,514	70	0.70

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 た り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 26 期	24,950,397,764円	20,662,088,869円	8,281円	70円	0.70%
第 27 期	24,658,603,196	20,103,120,380	8,153	70	0.70
第 28 期	24,522,781,429	19,650,459,252	8,013	70	0.70
第 29 期	24,186,095,675	19,375,574,352	8,011	70	0.70
第 30 期	23,778,092,322	19,357,598,191	8,141	70	0.70
第 31 期	23,730,563,902	19,113,291,497	8,054	70	0.70
第 32 期	23,577,632,522	18,565,132,969	7,874	70	0.70
第 33 期	23,224,580,737	18,082,463,111	7,786	70	0.70
第 34 期	22,966,597,866	17,472,628,861	7,608	70	0.70
第 35 期	22,314,974,400	16,798,904,950	7,528	70	0.70
第 36 期	21,979,677,218	17,741,649,695	8,072	70	0.70
第 37 期	21,715,166,797	16,767,406,730	7,722	70	0.70
第 38 期	21,122,216,315	16,002,201,011	7,576	70	0.70
第 39 期	20,532,617,178	15,402,182,220	7,501	70	0.70
第 40 期	20,033,194,177	14,157,767,720	7,067	70	0.70
第 41 期	19,849,203,874	14,135,469,739	7,121	70	0.70
第 42 期	19,538,076,059	12,929,514,158	6,618	70	0.70
第 43 期	19,294,753,205	12,932,353,057	6,703	70	0.70
第 44 期	18,966,740,179	12,365,932,355	6,520	70	0.70
第 45 期	18,718,939,145	11,869,408,168	6,341	70	0.70
第 46 期	18,324,294,907	12,438,088,582	6,788	70	0.70
第 47 期	18,011,485,469	12,921,491,583	7,174	70	0.70
第 48 期	17,789,326,227	12,166,696,487	6,839	70	0.70
第 49 期	17,667,971,431	11,733,550,874	6,641	70	0.70
第 50 期	17,555,776,092	11,133,457,775	6,342	70	0.70
第 51 期	17,340,551,454	11,240,661,998	6,482	70	0.70
第 52 期	17,158,149,788	11,055,661,154	6,443	70	0.70
第 53 期	15,360,440,913	9,837,033,795	6,404	70	0.70
第 54 期	14,355,985,314	9,248,847,851	6,443	50	0.50
第 55 期	13,336,013,050	8,625,976,684	6,468	50	0.50
第 56 期	12,318,405,391	8,379,734,196	6,803	50	0.50
第 57 期	11,370,640,498	8,471,250,959	7,450	50	0.50
第 58 期	10,616,613,227	8,214,033,742	7,737	50	0.50
第 59 期	9,720,092,002	7,660,379,877	7,881	50	0.50

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 60 期	9,088,873,895円	7,538,797,158円	8,295円	50円	0.50%
第 61 期	8,597,832,295	7,242,956,983	8,424	50	0.50
第 62 期	8,232,218,093	5,949,855,232	7,228	50	0.50
第 63 期	8,070,774,245	5,760,137,723	7,137	50	0.50
第 64 期	7,876,258,623	5,507,580,148	6,993	50	0.50
第 65 期	7,599,216,920	5,246,944,917	6,905	50	0.50
第 66 期	7,410,866,745	5,190,619,704	7,004	50	0.50
第 67 期	7,193,491,785	4,886,841,155	6,793	50	0.50
第 68 期	6,868,312,147	4,795,618,470	6,982	50	0.50
第 69 期	6,582,443,741	4,547,973,133	6,909	50	0.50
第 70 期	6,377,517,171	4,205,862,270	6,595	50	0.50
第 71 期	6,247,347,151	4,182,658,948	6,695	50	0.50
第 72 期	6,099,356,216	4,160,800,511	6,822	50	0.50
第 73 期	5,983,681,103	4,103,113,410	6,857	50	0.50
第 74 期	5,851,335,873	4,021,634,295	6,873	50	0.50
第 75 期	5,698,772,303	3,898,943,158	6,842	50	0.50
第 76 期	5,578,165,083	3,753,498,868	6,729	50	0.50
第 77 期	5,508,307,957	3,802,811,668	6,904	50	0.50
第 78 期	5,397,106,233	3,630,939,840	6,728	50	0.50
第 79 期	5,300,999,215	3,713,914,959	7,006	50	0.50
第 80 期	5,179,875,404	3,548,473,840	6,851	50	0.50
第 81 期	5,096,367,359	3,413,456,783	6,698	50	0.50
第 82 期	5,045,060,062	3,300,633,143	6,542	50	0.50
第 83 期	4,937,385,977	3,110,579,415	6,300	50	0.50
第 84 期	4,820,375,920	3,099,930,312	6,431	50	0.50
第 85 期	4,746,247,137	3,002,632,535	6,326	50	0.50
第 86 期	4,694,555,298	2,940,100,725	6,263	50	0.50
第 87 期	4,588,768,406	2,822,467,925	6,151	50	0.50
第 88 期	4,520,047,265	2,668,427,289	5,904	50	0.50
第 89 期	4,435,993,778	2,347,878,203	5,293	50	0.50
第 90 期	4,430,728,615	2,419,770,047	5,461	50	0.50
第 91 期	4,344,721,366	2,349,482,131	5,408	50	0.50
第 92 期	4,318,849,423	2,155,335,848	4,991	50	0.50
第 93 期	4,235,591,055	2,004,190,674	4,732	50	0.50

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 94 期	4,205,431,459円	1,929,613,313円	4,588円	50円	0.50%
第 95 期	4,176,877,112	2,028,971,454	4,858	50	0.50
第 96 期	4,136,125,468	1,960,891,267	4,741	50	0.50
第 97 期	4,095,840,846	1,935,398,158	4,725	50	0.50
第 98 期	4,059,250,468	1,875,430,655	4,620	50	0.50
第 99 期	4,062,709,722	1,838,460,537	4,525	50	0.50
第 100 期	3,985,170,650	1,804,554,389	4,528	50	0.50
第 101 期	3,966,928,243	1,771,455,739	4,466	50	0.50
第 102 期	3,943,392,073	1,755,830,558	4,453	50	0.50
第 103 期	3,917,595,490	1,644,464,059	4,198	50	0.50
第 104 期	3,879,276,227	1,749,774,689	4,511	50	0.50
第 105 期	3,836,995,065	1,726,136,583	4,499	50	0.50
第 106 期	3,870,803,458	1,762,084,468	4,552	50	0.50
第 107 期	3,845,443,005	1,749,530,627	4,550	50	0.50
第 108 期	3,818,526,066	1,687,509,772	4,419	50	0.50
第 109 期	3,788,599,200	1,741,433,426	4,597	50	0.50
第 110 期	3,790,405,716	1,716,812,509	4,529	50	0.50
第 111 期	3,781,587,038	1,725,800,907	4,564	50	0.50
第 112 期	3,763,120,587	1,663,492,164	4,421	50	0.50
第 113 期	3,744,933,878	1,695,895,880	4,529	50	0.50
第 114 期	3,732,934,214	1,669,914,158	4,473	50	0.50
第 115 期	3,656,104,656	1,598,051,346	4,371	50	0.50
第 116 期	3,642,840,808	1,598,781,160	4,389	50	0.50
第 117 期	3,609,373,332	1,603,961,062	4,444	50	0.50
第 118 期	3,611,983,240	1,558,161,191	4,314	50	0.50
第 119 期	3,709,079,624	1,585,564,048	4,275	50	0.50
第 120 期	3,780,864,397	1,583,647,034	4,189	50	0.50
第 121 期	3,810,015,310	1,544,932,395	4,055	50	0.50
第 122 期	3,685,074,626	1,419,536,354	3,852	50	0.50
第 123 期	3,750,637,731	1,432,295,756	3,819	50	0.50
第 124 期	3,878,782,564	1,409,268,628	3,633	50	0.50
第 125 期	3,848,663,656	1,333,628,020	3,465	50	0.50
第 126 期	3,866,788,965	1,370,014,344	3,543	50	0.50
第 127 期	3,873,357,010	1,392,485,028	3,595	25	0.25

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 128 期	3,801,156,641円	1,365,742,473円	3,593円	25円	0.25%
第 129 期	3,774,429,033	1,348,095,504	3,572	25	0.25
第 130 期	3,745,367,649	1,370,836,485	3,660	25	0.25
第 131 期	3,341,353,426	1,221,966,323	3,657	25	0.25
第 132 期	3,360,369,870	1,247,732,738	3,713	25	0.25
第 133 期	3,275,591,808	1,166,284,664	3,561	25	0.25
第 134 期	3,246,170,035	1,177,644,398	3,628	25	0.25
第 135 期	3,203,860,576	1,200,504,993	3,747	25	0.25
第 136 期	3,202,485,856	1,140,635,303	3,562	25	0.25
第 137 期	3,196,196,755	1,149,075,617	3,595	25	0.25
第 138 期	3,152,070,029	1,147,375,154	3,640	25	0.25
第 139 期	3,121,175,005	1,138,637,342	3,648	25	0.25
第 140 期	3,021,365,663	1,095,816,052	3,627	25	0.25
第 141 期	2,958,264,368	1,109,100,919	3,749	25	0.25
第 142 期	2,914,673,102	1,078,561,244	3,700	25	0.25
第 143 期	2,905,217,004	953,255,557	3,281	25	0.25
第 144 期	2,870,453,371	897,612,936	3,127	25	0.25
第 145 期	2,844,865,935	906,975,877	3,188	15	0.15
第 146 期	2,809,541,921	945,631,563	3,366	15	0.15
第 147 期	2,790,494,324	931,378,329	3,338	15	0.15
第 148 期	2,774,269,378	927,269,709	3,342	15	0.15
第 149 期	2,767,433,856	925,127,352	3,343	15	0.15
第 150 期	2,759,030,842	908,566,498	3,293	15	0.15
第 151 期	2,693,692,798	909,564,935	3,377	15	0.15
第 152 期	2,608,480,922	896,067,515	3,435	15	0.15
第 153 期	2,532,590,964	863,527,129	3,410	15	0.15
第 154 期	2,465,052,684	852,069,590	3,457	15	0.15
第 155 期	2,413,968,915	830,390,574	3,440	15	0.15
第 156 期	2,395,953,220	816,684,277	3,409	15	0.15
第 157 期	2,361,625,460	814,533,389	3,449	15	0.15
第 158 期	2,356,243,337	831,446,071	3,529	15	0.15
第 159 期	2,336,846,067	798,388,590	3,417	15	0.15
第 160 期	2,331,471,905	788,626,983	3,383	15	0.15
第 161 期	2,313,852,741	784,298,782	3,390	15	0.15

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 162 期	2,299,503,683円	772,621,768円	3,360円	15円	0.15%
第 163 期	2,250,890,724	756,033,464	3,359	15	0.15
第 164 期	2,241,205,399	733,177,172	3,271	15	0.15
第 165 期	2,223,916,487	735,657,374	3,308	15	0.15
第 166 期	2,203,414,113	745,983,224	3,386	15	0.15
第 167 期	2,184,733,716	681,733,755	3,120	15	0.15
第 168 期	2,192,164,445	739,052,528	3,371	15	0.15
第 169 期	2,167,643,523	704,496,812	3,250	15	0.15
第 170 期	2,157,752,686	730,728,260	3,387	15	0.15
第 171 期	2,157,225,568	707,287,976	3,279	15	0.15
第 172 期	2,124,080,085	708,050,317	3,333	15	0.15
第 173 期	2,110,487,367	730,335,741	3,461	15	0.15
第 174 期	2,109,502,867	701,079,417	3,323	15	0.15
第 175 期	1,945,396,793	632,615,667	3,252	15	0.15

償還金のお知らせ

1 万 口 当 たり 償 還 金 (税 引 前)	3,277円73銭
----------------------------	-----------

償還乗換えの優遇措置の適用について

当ファンドの償還金をもって他の証券投資信託をお求めになる場合には、購入時手数料のうち所定の額を返戻または割引く措置の適用を受けられる場合があります。優遇措置の適用は販売会社によって異なりますので、詳しくは取扱販売会社までお問い合わせ下さい。

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 AM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				<u>28</u>
(原価 \$51)				
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				<u>231</u>
(原価 \$262)				
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				<u>871</u>
(原価 \$803)				

		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				<u>101</u>
(原価 \$116)				
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				<u>134</u>
(原価 \$151)				
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				<u>73</u>
(原価 \$317)				
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				<u>170</u>
(原価 \$170)				

		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
BNP Paribas Bank		
(0.340%) due 03/01/2022	¥	17
0.005% due 03/01/2022	\$	50
0.005% due 03/01/2022	HKD	5
0.070% due 03/01/2022	SGD	1
3.950% due 03/01/2022	ZAR	28
Citibank N.A.		
0.005% due 03/01/2022	\$	64
DBS Bank Ltd.		
0.005% due 03/01/2022		13
HSBC Bank PLC		
(0.780%) due 03/01/2022	EUR	1
JPMorgan Chase Bank N.A.		
0.005% due 03/01/2022	\$	15
MUFG Bank Ltd.		
(0.340%) due 03/01/2022	¥	16
Royal Bank of Canada		
0.005% due 03/01/2022	\$	128
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.780%) due 03/01/2022	EUR	2
(0.340%) due 03/01/2022	¥	11
0.005% due 03/01/2022	\$	201
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.340%) due 03/01/2022	¥	1
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	
	買建オプション	先物	スワップ	合計		売建オプション	先物	スワップ	合計
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	\$	0
CBK	03/2022		35		144		0
CBK	03/2022		45	RUB	3,359		(10)
CBK	03/2022		38	THB	1,283		0
CBK	03/2022		6	UYU	268		0
CBK	04/2022	ILS	500	\$	153		(3)
CBK	04/2022	MXN	103		5		0
CBK	04/2022	PEN	502		125		(7)
CBK	04/2022	THB	1,962		61		0
CBK	04/2022		1,549		48		0
CBK	04/2022	\$	59	THB	1,962		0
CBK	04/2022		46		1,549		0
CBK	04/2022		2	TRY	27		(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)。

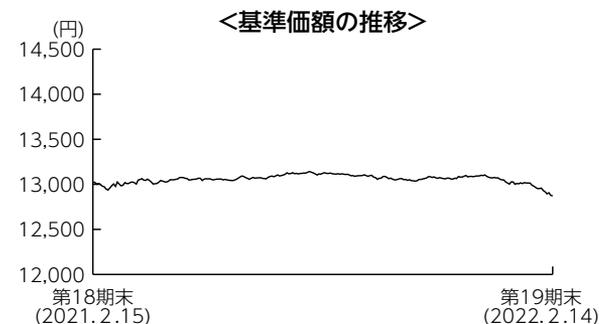
■当期中の基準価額と市況の推移

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）

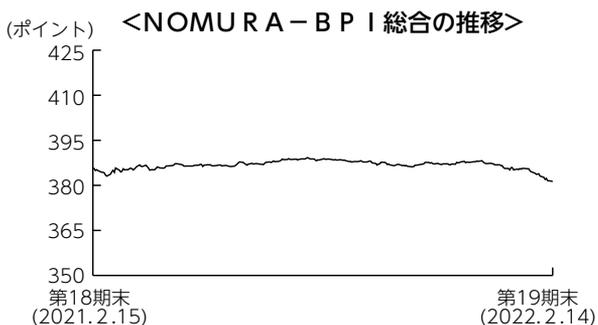


基準価額の推移

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。

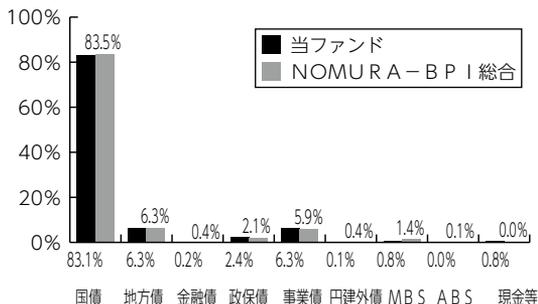
ポートフォリオについて

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。

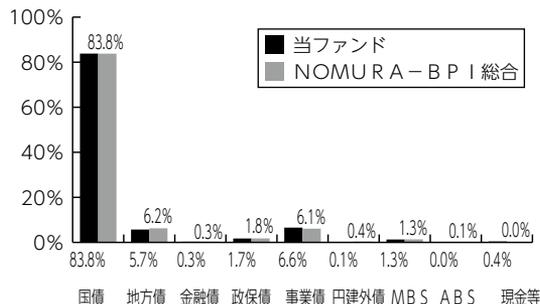
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

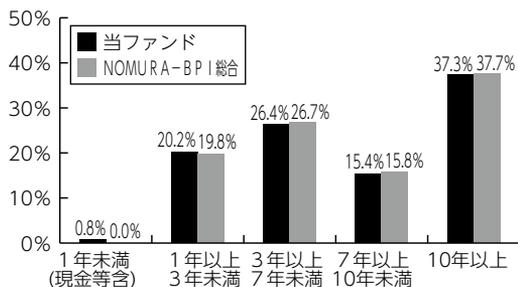


期末

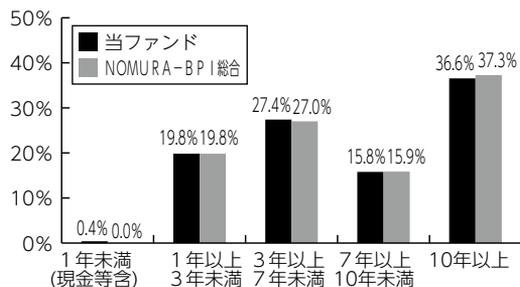


○残存年限別構成比

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		
	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 証 券	25,151,985	26,325,307	4.8	0.0	3.3	0.8	0.6
金 融 債 証 券	1,800,000	1,796,652	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 証 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	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
83回 利付国庫債券(20年)	2.1000	70,000	75,621	2025/12/20
84回 利付国庫債券(20年)	2.0000	170,000	182,998	2025/12/20
147回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,000,000	3,999,160	2026/03/20
342回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,980,000	3,994,606	2026/03/20
85回 利付国庫債券(20年)	2.1000	590,000	640,415	2026/03/20
86回 利付国庫債券(20年)	2.3000	120,000	131,235	2026/03/20
87回 利付国庫債券(20年)	2.2000	120,000	130,744	2026/03/20
148回 利付国庫債券(5年)	0.0050	3,900,000	3,898,284	2026/06/20
343回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,350,000	4,366,008	2026/06/20
88回 利付国庫債券(20年)	2.3000	590,000	648,504	2026/06/20
89回 利付国庫債券(20年)	2.2000	10,000	10,948	2026/06/20
149回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,200,000	4,196,136	2026/09/20
344回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,790,000	5,809,917	2026/09/20
90回 利付国庫債券(20年)	2.2000	470,000	516,910	2026/09/20
91回 利付国庫債券(20年)	2.3000	110,000	121,484	2026/09/20
150回 利付国庫債券(5年)	0.0050	1,300,000	1,298,102	2026/12/20
345回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,190,000	5,206,296	2026/12/20
92回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,160,000	1,275,826	2026/12/20
346回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,740,000	4,754,409	2027/03/20
93回 利付国庫債券(20年)	2.0000	370,000	406,837	2027/03/20
94回 利付国庫債券(20年)	2.1000	670,000	740,108	2027/03/20
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,030,000	5,044,737	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	550,000	616,099	2027/06/20
96回 利付国庫債券(20年)	2.1000	120,000	133,142	2027/06/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,990,000	5,003,872	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	739,160	2027/09/20
98回 利付国庫債券(20年)	2.1000	160,000	178,297	2027/09/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,430,000	4,441,606	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	839,340	2027/12/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,210,000	5,221,045	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	830,000	937,783	2028/03/20
101回 利付国庫債券(20年)	2.4000	230,000	262,657	2028/03/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,600,000	4,608,694	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	500,000	573,740	2028/06/20
103回 利付国庫債券(20年)	2.3000	160,000	182,587	2028/06/20
104回 利付国庫債券(20年)	2.1000	110,000	124,138	2028/06/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,440,000	4,447,281	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	640,000	725,280	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	569,905	2028/09/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,810,000	4,816,541	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	600,000	682,722	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	690,000	775,739	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,060,000	4,064,263	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	350,000	394,908	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	502,660	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,310,000	4,311,551	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	460,000	530,794	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	740,000	848,491	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,640,000	3,637,233	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	110,000	132,286	2029/09/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,170,000	1,345,862	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,690,000	3,684,243	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	820,000	946,895	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	360,000	418,510	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	118,144	2030/02/20
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,550,000	3,541,444	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	530,000	618,329	2030/03/20
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,070,000	1,239,744	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,260,000	4,245,942	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	555,000	640,653	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	470,000	534,775	2030/06/20
120回 利付国庫債券(20年)	1.6000	670,000	751,277	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,040,000	4,022,830	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	790,000	908,073	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	650,352	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	247,670	2030/11/20
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,000,000	3,977,320	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,050,000	1,228,164	2030/12/20
124回 利付国庫債券(20年)	2.0000	600,000	696,576	2030/12/20
362回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,750,000	4,715,990	2031/03/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	709,350	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	510,000	593,813	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	623,905	2031/03/20
363回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,800,000	4,760,304	2031/06/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	1,370,000	1,587,227	2031/06/20
129回 利付国庫債券(20年)	1.8000	760,000	873,521	2031/06/20
364回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,400,000	4,356,528	2031/09/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	910,000	1,048,047	2031/09/20
131回 利付国庫債券(20年)	1.7000	790,000	902,401	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	242,360	2031/11/20
365回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,300,000	1,285,583	2031/12/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	830,000	950,184	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,030,000	1,189,093	2031/12/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	800,000	925,224	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	640,000	733,862	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	660,000	750,274	2032/03/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	800,000	918,800	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,340,000	1,511,908	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	920,000	1,047,318	2032/06/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,290,000	2,634,072	2032/09/20
8回 利付国庫債券(30年)	1.8000	200,000	232,380	2032/11/22
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,580,000	1,819,938	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,500,000	1,743,615	2032/12/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,480,000	1,691,033	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,310,000	1,482,697	2033/03/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	250,000	288,867	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,350,000	2,715,354	2033/06/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	230,000	276,696	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,280,000	2,639,122	2033/09/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	150,000	179,062	2033/12/20

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)					
147回	利付国庫債券(20年)	1.6000	2,350,000	2,696,319	2033/12/20
14回	利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	422,810	2034/03/20
148回	利付国庫債券(20年)	1.5000	2,210,000	2,512,084	2034/03/20
15回	利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	327,298	2034/06/20
149回	利付国庫債券(20年)	1.5000	2,270,000	2,583,441	2034/06/20
16回	利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	302,973	2034/09/20
150回	利付国庫債券(20年)	1.4000	2,440,000	2,750,685	2034/09/20
17回	利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	338,447	2034/12/20
151回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,460,000	2,713,675	2034/12/20
18回	利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	497,632	2035/03/20
152回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,340,000	2,582,494	2035/03/20
19回	利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	349,154	2035/06/20
153回	利付国庫債券(20年)	1.3000	2,620,000	2,926,068	2035/06/20
20回	利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	420,977	2035/09/20
154回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,690,000	2,969,356	2035/09/20
21回	利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	388,023	2035/12/20
155回	利付国庫債券(20年)	1.0000	2,460,000	2,650,133	2035/12/20
22回	利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	371,727	2036/03/20
156回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,550,000	2,538,142	2036/03/20
23回	利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	449,694	2036/06/20
157回	利付国庫債券(20年)	0.2000	2,430,000	2,346,553	2036/06/20
24回	利付国庫債券(30年)	2.5000	270,000	347,706	2036/09/20
158回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,690,000	2,706,543	2036/09/20
25回	利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	416,394	2036/12/20
159回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,480,000	2,526,475	2036/12/20
26回	利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	792,521	2037/03/20
160回	利付国庫債券(20年)	0.7000	2,010,000	2,073,676	2037/03/20
161回	利付国庫債券(20年)	0.6000	1,890,000	1,919,654	2037/06/20
27回	利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	805,206	2037/09/20
162回	利付国庫債券(20年)	0.6000	1,820,000	1,846,317	2037/09/20
163回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,070,000	2,097,303	2037/12/20
28回	利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	1,003,825	2038/03/20
164回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,680,000	2,668,074	2038/03/20
165回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,310,000	2,296,116	2038/06/20
29回	利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,112,083	2038/09/20
166回	利付国庫債券(20年)	0.7000	1,830,000	1,873,151	2038/09/20
167回	利付国庫債券(20年)	0.5000	1,970,000	1,950,300	2038/12/20
30回	利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,126,734	2039/03/20
168回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,680,000	1,632,976	2039/03/20
169回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,950,000	1,858,096	2039/06/20
31回	利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	912,038	2039/09/20
170回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,420,000	1,348,971	2039/09/20
171回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,740,000	1,649,206	2039/12/20
32回	利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,248,263	2040/03/20
172回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,510,000	1,453,586	2040/03/20
173回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,120,000	2,036,472	2040/06/20
33回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,462,456	2040/09/20
174回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,990,000	1,907,454	2040/09/20
175回	利付国庫債券(20年)	0.5000	1,930,000	1,879,820	2040/12/20
34回	利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,532,796	2041/03/20

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)					
176回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,080,000	2,021,843	2041/03/20
177回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,300,000	2,191,785	2041/06/20
35回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,460,000	1,818,371	2041/09/20
178回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,100,000	2,036,391	2041/09/20
179回	利付国庫債券(20年)	0.5000	800,000	776,176	2041/12/20
36回	利付国庫債券(30年)	2.0000	2,170,000	2,712,239	2042/03/20
37回	利付国庫債券(30年)	1.9000	2,260,000	2,788,297	2042/09/20
38回	利付国庫債券(30年)	1.8000	1,550,000	1,885,854	2043/03/20
39回	利付国庫債券(30年)	1.9000	1,220,000	1,510,055	2043/06/20
40回	利付国庫債券(30年)	1.8000	940,000	1,145,784	2043/09/20
41回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,080,000	1,295,665	2043/12/20
42回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,120,000	1,344,560	2044/03/20
43回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,120,000	1,345,489	2044/06/20
44回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,130,000	1,358,395	2044/09/20
45回	利付国庫債券(30年)	1.5000	1,270,000	1,474,444	2044/12/20
46回	利付国庫債券(30年)	1.5000	1,670,000	1,939,404	2045/03/20
47回	利付国庫債券(30年)	1.6000	1,310,000	1,549,651	2045/06/20
48回	利付国庫債券(30年)	1.4000	1,640,000	1,870,567	2045/09/20
49回	利付国庫債券(30年)	1.4000	1,460,000	1,665,422	2045/12/20
50回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,660,000	1,675,222	2046/03/20
51回	利付国庫債券(30年)	0.3000	1,350,000	1,211,233	2046/06/20
52回	利付国庫債券(30年)	0.5000	1,510,000	1,418,358	2046/09/20
53回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,200,000	1,151,448	2046/12/20
54回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,450,000	1,454,553	2047/03/20
55回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,520,000	1,523,207	2047/06/20
56回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,230,000	1,231,303	2047/09/20
57回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,300,000	1,300,000	2047/12/20
1回	利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	151,087	2048/03/20
58回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,670,000	1,666,392	2048/03/20
59回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,520,000	1,478,884	2048/06/20
60回	利付国庫債券(30年)	0.9000	1,130,000	1,149,729	2048/09/20
61回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,140,000	1,102,619	2048/12/20
2回	利付国庫債券(40年)	2.2000	630,000	836,621	2049/03/20
62回	利付国庫債券(30年)	0.5000	1,070,000	981,050	2049/03/20
63回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,160,000	1,032,724	2049/06/20
64回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,180,000	1,048,418	2049/09/20
65回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,010,000	895,567	2049/12/20
3回	利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	720,835	2050/03/20
66回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,090,000	965,631	2050/03/20
67回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,550,000	1,446,615	2050/06/20
68回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,340,000	1,249,992	2050/09/20
69回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,450,000	1,388,360	2050/12/20
4回	利付国庫債券(40年)	2.2000	720,000	966,996	2051/03/20
70回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,420,000	1,359,224	2051/03/20
71回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,600,000	1,531,040	2051/06/20
72回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,500,000	1,434,915	2051/09/20
73回	利付国庫債券(30年)	0.7000	600,000	573,792	2051/12/20
5回	利付国庫債券(40年)	2.0000	1,010,000	1,311,889	2052/03/20
6回	利付国庫債券(40年)	1.9000	1,030,000	1,317,009	2053/03/20
7回	利付国庫債券(40年)	1.7000	1,190,000	1,463,473	2054/03/20

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
8回	利付国庫債券(40年)	1.4000	1,310,000	1,505,792 2055/03/20
9回	利付国庫債券(40年)	0.4000	1,950,000	1,675,966 2056/03/20
10回	利付国庫債券(40年)	0.9000	1,820,000	1,829,755 2057/03/20
11回	利付国庫債券(40年)	0.8000	1,480,000	1,441,638 2058/03/20
12回	利付国庫債券(40年)	0.5000	1,400,000	1,228,892 2059/03/20
13回	利付国庫債券(40年)	0.5000	1,730,000	1,512,244 2060/03/20
14回	利付国庫債券(40年)	0.7000	1,700,000	1,585,624 2061/03/20
小 計		-	447,045,000	463,797,306 -
(地方債証券)		%	千円	千円
7 1 9回	東京都公募公債	0.8600	200,000	201,858 2023/03/20
12 1回	共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	503,335 2023/04/25
2 5年度4回	愛知県公募公債	0.8560	300,000	303,270 2023/05/30
7 2 0回	東京都公募公債	0.8700	300,000	303,474 2023/06/20
1回	東京都公募公債 20年	1.5400	100,000	102,059 2023/06/20
2 5年度4回	札幌市公募公債	0.8000	200,000	202,128 2023/06/20
2 5年度2回	横浜市公募公債	0.8880	400,000	404,956 2023/07/14
3 7 4回	大阪府公募公債	0.9380	300,000	304,038 2023/07/28
2 5年度5回	千葉県公募公債	0.8400	200,000	202,532 2023/08/25
2 5年度6回	千葉県公募公債	0.8000	100,000	101,271 2023/09/25
2 9回1号	宮城県公募公債 10年	0.6800	100,000	101,134 2023/10/25
1 2 7回	共同発行市場公募地方債	0.6800	100,000	101,134 2023/10/25
1 2 8回	共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	303,459 2023/11/24
2 5年度2回	島根県公募公債	0.6700	106,000	107,246 2023/11/27
7 2 6回	東京都公募公債	0.7300	400,000	405,316 2023/12/20
2 5年度8回	埼玉県公募公債	0.7030	100,000	101,289 2023/12/25
2 5年度11回	福岡県公募公債	0.6940	200,000	202,736 2024/02/26
2 5年度2回	新潟県公募公債	0.6700	100,000	101,322 2024/02/28
1 3 2回	共同発行市場公募地方債	0.6600	100,000	101,345 2024/03/25
2 0 8回	神奈川県公募公債	0.5510	300,000	303,732 2024/06/20
2 6年度4回	札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	101,219 2024/06/20
1回	兵庫県公募公債(12年)	1.1000	300,000	307,608 2024/06/26
2 6年度4回	神戸市公募公債	0.6060	100,000	101,402 2024/07/18
2 6年度5回	埼玉県公募公債	0.6110	400,000	405,720 2024/07/29
4 8 8回	名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	456,633 2024/09/20
2 6年度1回	相模原市公募公債	0.5290	100,000	101,295 2024/09/20
2 6年度1回	長崎県公募公債	0.5540	100,000	101,361 2024/09/30
2 6年度1回	静岡市公募公債	0.5150	100,000	101,332 2024/11/25
2 6年度11回	京都府公募公債	0.4760	350,000	354,382 2024/12/19
2 6年度1回	三重県公募公債	0.4560	100,000	101,188 2024/12/25
2 6年度1回	浜松市公募公債	0.3350	100,000	100,866 2025/01/23
1 4 2回	共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	504,480 2025/01/24
2 6年度3回	広島市公募公債	0.4290	100,000	101,177 2025/02/25
2 6年度17回	兵庫県公募公債	0.4600	200,000	202,544 2025/02/26
5回	東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	106,390 2025/03/19
2 1 3回	神奈川県公募公債	0.5340	100,000	101,524 2025/03/19
1 4 4回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	405,336 2025/03/25
1 4 6回	共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	610,044 2025/05/23
1 4 8回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	508,730 2025/07/25
7回	東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	107,575 2025/09/19
1回	静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	107,627 2025/09/19

銘	柄	当 期 末		
		利率	額面金額	評 価 額 償還年月日
(地方債証券)		%	千円	千円
27年度15回	愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	101,571 2025/11/27
1 5 3回	共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,575 2025/12/25
2 7年度9回	千葉県公募公債	0.0950	100,000	100,122 2026/03/25
1 5 7回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	120,074 2026/04/24
9回	東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	220,570 2026/06/19
1 5 9回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,998 2026/06/25
1回	兵庫県公募公債 15年	1.6600	200,000	214,114 2026/07/29
2 8年度6回	北海道公募公債	0.0700	100,000	99,977 2026/08/31
7 6 0回	東京都公募公債	0.0450	100,000	99,862 2026/09/18
1 0回	東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	330,960 2026/09/18
4回	京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	111,143 2026/09/18
4 1 3回	共同発行市場公募公債 10年	0.0210	100,000	99,723 2026/10/28
1 6 6回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	502,335 2027/01/25
2 8年度8回	福岡県公募公債	0.2400	100,000	100,725 2027/02/24
4 1 9回	大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	100,392 2027/04/27
2回	静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	106,848 2027/06/25
5回	兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	103,010 2027/07/07
2 9年度4回	大阪府公募公債	0.1500	200,000	199,998 2027/09/21
1 7 4回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,972 2027/09/24
2 4年度1回	福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	106,797 2027/11/29
1 7 8回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	100,471 2028/01/25
1 7 9回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	502,535 2028/02/25
2 9年度6回	広島市公募公債	0.2300	300,000	301,341 2028/02/25
2 9年度13回	京都府公募公債	0.2000	109,330	109,626 2028/03/16
5回	兵庫県公募公債 15年	1.3100	300,000	321,342 2028/05/26
7 8 3回	東京都公募公債	0.2200	110,000	110,413 2028/06/20
4回	静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	107,343 2028/06/23
3 0年度7回	神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	301,740 2028/09/20
第 9 1回	川崎市公募公債	0.1850	200,000	200,260 2028/09/20
7回	静岡県公募公債 20年	2.3200	300,000	342,096 2028/09/21
3 0年度3回	広島県公募公債	0.2540	100,000	100,581 2028/09/25
3 0年度3回	堺市公募公債	0.1950	100,000	100,067 2028/12/19
2 3 7回	神奈川県公募公債	0.1350	200,000	199,458 2028/12/20
2 0回2号	福岡県公募公債	2.0500	100,000	112,685 2028/12/20
6回	大阪府公募公債 20年	2.2100	200,000	227,612 2028/12/20
1 7回	横浜市公募公債 20年	2.0700	100,000	112,820 2028/12/20
6回	北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	112,474 2028/12/20
3 0年度6回	福岡県公募公債	0.2000	200,000	200,406 2028/12/21
1 8 9回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	100,237 2028/12/25
3 0年度14回	北海道公募公債	0.1950	400,000	400,132 2028/12/28
1 8回	東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	114,282 2029/03/19
3 0年度19回	愛知県公募公債	0.1150	200,000	199,016 2029/03/28
3 0年度3回	岡山県公募公債 10年	0.1500	200,000	199,508 2029/03/29
1 9 4回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	298,275 2029/05/25
6回	川崎市公募公債 20年	2.2100	200,000	228,986 2029/05/25
令和元年度1回	福岡県公募公債	0.0290	200,000	197,594 2029/06/21
9回	兵庫県公募公債 15年	1.0200	100,000	105,986 2029/07/13
11回	神奈川県公募公債 20年	2.0800	100,000	113,800 2029/07/20
7 9 6回	東京都公募公債	0.0400	200,000	197,530 2029/09/20
令和元年度 9回	静岡県公募公債	0.0500	200,000	197,680 2029/09/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
令和元年度3回 横浜市公募債	0.0500	400,000	395,316	2029/10/16
令和元年度16回 兵庫県公募債	0.0500	200,000	197,652	2029/10/23
21回 東京都公募債 20年	2.1900	100,000	115,284	2029/12/20
17回 さいたま市公募債	0.1100	200,000	198,376	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募債	0.1350	200,000	198,670	2030/01/30
21年度2回 福岡県公募債 (20年)	2.2300	100,000	115,890	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	99,013	2030/02/25
802回 東京都公募債	0.1300	400,000	396,980	2030/03/19
511回 名古屋市長公募債 10年	0.0750	200,000	197,608	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公募債	0.1350	400,000	397,116	2030/04/12
令和2年2回 大阪府公募債	0.1310	300,000	297,588	2030/05/22
9回 埼玉県公募債 20年	2.1500	100,000	115,631	2030/05/24
8回 静岡県公募債 15年	0.8280	200,000	209,836	2030/06/07
令和2年度10回 静岡県公募債	0.1350	100,000	99,073	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公募債	0.1350	100,000	99,522	2030/10/23
36回2号 宮城県公募債 10年	0.1350	250,000	247,500	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
22年度14回 愛知県公募債	2.0870	300,000	347,595	2030/12/13
9回 京都市公募債 20年	2.1430	200,000	232,738	2030/12/17
813回 東京都公募債	0.1790	300,000	297,897	2030/12/20
16回 神奈川県公募債 20年	2.0900	300,000	348,129	2031/01/24
464回 大阪府公募債 10年	0.0720	200,000	196,622	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公募債	0.1450	100,000	98,897	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公募債	0.2140	200,000	199,184	2031/03/12
令和2年7回 広島県公募債	0.2140	200,000	199,182	2031/03/19
251回 神奈川県公募債 10年	0.1990	200,000	198,826	2031/03/20
令和2年度14回 静岡県公募債	0.1400	200,000	197,780	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公募債 10年	0.1900	200,000	198,682	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公募債	0.1750	100,000	99,165	2031/04/25
467回 大阪府公募債 10年	0.1640	200,000	197,956	2031/04/28
469回 大阪府公募債 10年	0.1280	200,000	197,136	2031/06/27
令和3年5回 千葉県公募債 10年	0.1050	200,000	196,712	2031/09/25
472回 大阪府公募債 10年	0.1000	200,000	196,436	2031/09/29
19回 神奈川県公募債 20年	1.8180	100,000	114,954	2032/01/30
24年度2回 福岡県公募債 (20年)	1.6350	300,000	340,239	2032/08/16
10回 大阪府公募債 20年	1.7200	200,000	228,482	2032/09/24
24年度12回 神戸市公募債	1.7110	200,000	228,902	2032/12/17
14回 千葉県公募債 20年	1.1370	100,000	108,398	2033/04/15
13回 埼玉県公募債 20年	1.5990	100,000	113,533	2033/05/20
1回 東京都公募債 30年	2.2100	200,000	240,730	2033/06/20
14回 埼玉県公募債 20年	1.5460	300,000	340,266	2034/05/08
29回 横浜市公募債 20年	1.5280	100,000	113,263	2034/05/26
16回 名古屋市公募債 20年	1.5200	100,000	113,143	2034/06/09
5回 群馬県公募債 20年	1.5290	100,000	113,268	2034/06/16
17回 北九州市公募債 20年	1.5290	100,000	113,146	2034/06/20
15回 埼玉県公募債 20年	1.1660	100,000	108,996	2035/02/16
2回 横浜市公募債 30年	2.4900	100,000	125,684	2035/03/20
18回 千葉県公募債 20年	1.1380	100,000	108,681	2035/04/13
17回 名古屋市公募債 20年	1.2030	100,000	109,504	2035/05/28

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
13回 大阪府公募債 20年	1.2030	100,000	109,382	2035/09/28
14回 大阪府公募債 20年	0.5400	100,000	100,067	2036/09/29
21回 千葉県公募債 20年	0.4240	100,000	98,557	2036/10/15
3回 神奈川県公募債 30年	2.6200	100,000	129,747	2037/03/19
29年度2回 広島市公募債	0.6160	200,000	201,596	2037/08/18
29年度5回 札幌市公募債 20年	0.5970	300,000	301,374	2037/09/18
30年度2回 仙台市公募債 20年	0.7290	100,000	101,875	2038/10/18
30年度7回 福岡市公募債	0.7010	200,000	202,748	2038/10/19
2019年度5回 福岡市公募債 20年	0.2860	100,000	94,215	2039/07/29
2回 兵庫県公募債 30年	2.3600	100,000	128,860	2040/03/19
22年度8回 福岡市公募債	2.2800	100,000	127,719	2040/09/20
令和2年2回 広島県公募債	0.4640	100,000	96,353	2040/09/21
23年度7回 札幌市公募債 30年	2.0970	100,000	125,408	2041/09/20
5回 川崎市公募債 30年	2.0970	100,000	125,839	2042/03/20
24年度12回 愛知県公募債 30年	2.1200	100,000	126,252	2042/09/19
14回 東京都公募債 30年	2.0500	100,000	125,309	2043/06/19
27年度8回 愛知県公募債 30年	1.5790	150,000	174,357	2045/06/20
27年度2回 広島県公募債 30年	0.7110	100,000	97,493	2046/03/22
6回 埼玉県公募債 30年	0.9570	200,000	204,822	2046/12/20
令和元年度1回 島根県公募債	0.2900	200,000	189,308	2049/09/17
5回 京都市公募債 30年定時償還	0.2900	200,000	189,826	2049/09/17
令和3年度6回 神戸市公募債 30年	0.7130	200,000	189,564	2051/06/20
小計	-	30,445,330	31,523,404	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
19回 政保日本政策投資銀行社債	0.6680	100,000	100,742	2023/03/15
55回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	504,550	2023/03/20
189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.5410	500,000	503,365	2023/04/28
18回 国際協力機構債券	0.8680	100,000	101,155	2023/06/20
193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.8820	500,000	506,195	2023/06/30
50回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	506,570	2023/07/14
195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.9110	430,000	435,835	2023/07/31
116回 高速道路機構債	0.7220	100,000	101,136	2023/09/20
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6990	105,000	106,289	2023/10/31
56回 政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	550,010	2024/01/19
7回 広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	0.6940	100,000	101,052	2024/02/28
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6600	100,000	101,364	2024/02/29
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6600	100,000	101,533	2024/05/31
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6440	200,000	203,092	2024/06/28
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	304,170	2024/09/13
139回 日本高速道路保有・債務返済機構債	0.5000	100,000	101,219	2024/09/20
71回 鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	101,362	2024/11/27
21回 政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	101,357	2025/03/17
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4500	500,000	506,870	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	101,199	2025/04/25
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,941	2025/06/20
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4400	100,000	101,487	2025/08/29
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,949	2025/09/19
85回 中日本高速道路債券	0.0700	300,000	299,841	2025/10/21
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,676	2025/11/20
23回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	107,806	2025/12/19

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	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	106,809	2025/12/19
4 0 回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,957	2026/03/13
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	110,249	2026/03/20
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	100,104	2026/04/20
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	400,416	2026/04/28
8 0 回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	106,928	2026/09/18
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	498,510	2026/09/18
7 9 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	320,157	2026/11/06
9 1 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	100,168	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	100,296	2027/01/29
F 1 4 7 回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	211,904	2027/03/19
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	301,767	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	801,656	2027/04/30
7 2 回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	199,734	2027/06/18
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	100,269	2027/07/16
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	301,113	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	100,231	2027/12/17
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	107,376	2027/12/20
7 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	299,130	2027/12/20
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	301,425	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	100,521	2028/10/16
9 回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	213,926	2028/12/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	225,488	2028/12/20
9 3 回 都市再生債券	1.1020	100,000	106,336	2029/06/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	344,622	2029/06/28
2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	345,489	2029/08/28
1 2 回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	212,340	2029/09/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	228,672	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	114,896	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	104,386	2030/05/28
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	210,748	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	228,104	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	567,995	2030/10/31
1 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	116,328	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	198,172	2031/05/30
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	406,605	2031/06/13
7 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	115,414	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	114,749	2031/12/26
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	229,494	2031/12/26
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	113,574	2032/07/28
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	114,784	2032/09/14
1 5 回 国際協力機構債券	1.7240	100,000	113,908	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	227,792	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	111,437	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	637,360	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	112,737	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	113,297	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	327,033	2035/02/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	107,835	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	110,076	2035/06/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	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	220,534	2035/06/28
2 5 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	110,643	2035/06/29
1 7 2 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	192,904	2036/06/20
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	101,313	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	29,689	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	20,925	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	31,961	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	202,422	2037/07/31
2 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	261,262	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	34,022	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	100,279	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	99,389	2038/04/20
2 1 0 回 高速道路機構債	0.6770	100,000	100,551	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	336,891	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	119,376	2040/08/31
4 0 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	50,096	51,467	2041/03/10
4 3 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	11,209	11,425	2041/06/10
4 4 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	53,795	54,809	2041/07/10
5 1 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	32,226	32,671	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	53,678	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	11,161	2042/08/10
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	306,622	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	19,689	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	119,648	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	183,008	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	115,645	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	25,431	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	224,626	2045/10/31
1 6 9 回 高速道路機構債	1.2000	100,000	106,929	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	109,865	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	22,067	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	26,249	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	27,540	2046/10/10
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	211,822	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	37,405	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	83,805	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	36,402	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	42,429	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	43,162	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	47,063	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	48,980	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	53,535	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	60,561	2050/05/10
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	93,581	2050/06/20
1 6 5 回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	187,562	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	63,305	2050/08/10
4 1 8 回 高速道路機構債	0.6300	200,000	186,310	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	189,248	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	226,942	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	77,568	2052/02/10

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	77,103	77,288	2052/03/10
119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,191	77,317	2052/04/10
120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	241,122	240,948	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	241,002	240,671	2053/01/10
130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	163,316	163,084	2053/03/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,409	244,643	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,211	244,521	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	424,330	425,004	2053/10/10
139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	84,346	84,415	2053/12/10
142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	87,002	86,223	2054/03/10
154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	276,159	273,005	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	122,990	2055/03/19
156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	369,132	366,160	2055/05/10
160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	283,044	281,119	2055/09/10
168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	290,907	289,478	2056/05/10
170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	881,010	873,486	2056/07/10
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	183,480	2061/02/28
小計	-	25,151,985	26,325,307	-
(金融債券)	%	千円	千円	
342回 利附信金中金債(5年)	0.1100	100,000	100,077	2023/05/26
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,101	2024/05/27
い第843号 利付商工債	0.1200	100,000	100,002	2025/08/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	399,584	2025/08/27
い第851号 利付商工債	0.0900	300,000	299,247	2026/04/27
377回 利附信金中金債(5年)	0.0400	300,000	299,247	2026/04/27
い第854号 利付商工債	0.0800	300,000	299,070	2026/07/27
い第855号 利付商工債	0.0800	200,000	199,324	2026/08/27
小計	-	1,800,000	1,796,652	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	201,960	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	100,813	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	201,714	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	101,144	2023/03/24
5回 ファーストリテイリング社債	0.1100	100,000	100,014	2023/06/06
23回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	303,507	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	200,000	202,124	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	202,312	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	101,399	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	406,036	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	309,228	2023/09/20
26回 フランス銀行東京支店銀行(BFCM)円債(2018)	0.4430	100,000	100,225	2023/10/12
48回 クレディ・アグリコル社債	1.0380	100,000	101,521	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	101,166	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	203,762	2023/11/24
56回 中日本高速道路社債	0.7590	100,000	101,345	2023/12/20
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	206,906	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	304,485	2023/12/20
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	407,364	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	407,084	2024/02/23
13回 新生銀行社債	0.1500	200,000	199,664	2024/03/12

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	
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	202,226	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	104,259	2024/03/19
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	101,598	2024/04/25
2回 BPCE SA円貸社債(ソーシャルボンド)	0.3670	100,000	99,964	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	101,795	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	101,123	2024/09/03
25回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,909	2024/09/20
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	105,384	2024/09/20
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	101,361	2024/10/28
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	202,522	2024/10/28
4回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,794	2024/10/31
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貸社債	0.8650	200,000	202,624	2024/11/28
25回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	202,578	2024/12/20
11回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	202,466	2024/12/20
321回 北海道電力社債	0.8860	261,000	265,865	2024/12/25
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	101,257	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,738	2025/05/21
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,822	2025/06/11
12回 セン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,975	2025/06/20
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	318,549	2025/06/20
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	102,562	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	212,108	2025/06/20
12回 新生銀行社債	0.3600	400,000	400,780	2025/07/09
27回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	213,564	2025/09/19
42回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	399,540	2025/12/19
14回 セン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,792	2025/12/19
26回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	199,146	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,840	2026/03/24
96回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,565	2026/04/15
163回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,954	2026/04/15
28回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	298,170	2026/04/21
493回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,520	2026/05/25
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,410	2026/05/26
24回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,954	2026/06/03
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,434	2026/06/03
35回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,050	2026/06/05
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貸社債(2016)	0.4000	100,000	99,418	2026/06/10
57回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	100,064	2026/06/19
79回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	299,349	2026/06/19
83回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	199,566	2026/06/19
69回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	298,221	2026/06/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	131,178	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	103,449	2026/06/25
90回 中日本高速道路債	0.0500	200,000	199,556	2026/07/27
20回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	299,763	2026/07/27
91回 中日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/17
62回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/18
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,801	2026/09/18
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,999	2026/10/23
33回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	302,304	2026/12/14

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
3 4 回 西日本高速道路債券	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
25回 フランス信託証券(銀行 (RF C/M) 円社債 (2017))	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
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	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
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	99,654	2029/04/12
1 4 回 プリダストーン社債	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
(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
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	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 ・ 公 司 未 前 負 未 純 資 産 元 次 受 取 払 解 約 総 額(A-B) 期 繰 越 損 益 受 益 権 総 口 数	49,696,366,967 551,087,616,706 809,631,617 242,217,221 48,532,656,000 48,532,656,000 553,303,176,511 429,840,166,151 123,463,010,360 429,840,166,151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(中立型)	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(中立型)	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50VA (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・セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	113,717,437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 アスク 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	
	その他の収益	4,106,122	
	支払利息	△958,146	
(B)	有価証券売買損益	△10,450,257,321	
	売却益	660,402,300	
	売却損	△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。