

運用報告書 (全体版)

第13期<決算日2021年5月10日>

MHAM外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	2008年6月3日から無期限です。	
運用方針	F T S E世界国債インデックス (除く日本) に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、F T S E世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の動きに連動する投資成果を目指します。	
主要投資対象	MHAM外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	MHAM外国債券インデックスマザーファンド	F T S E世界国債インデックス (除く日本) に採用されている国・地域の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。 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。	
組入制限	MHAM外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	MHAM外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎年原則として5月8日に決算を行い、経費控除後の繰越分を含めた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の範囲とし、分配金額は委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAM外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)」は、2021年5月10日に第13期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

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

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

MHAM外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	円	%	ポイント	%			
9期(2017年5月8日)	11,876	0	1.5	439.54	2.5	98.1	—	百万円 585
10期(2018年5月8日)	11,995	0	1.0	447.08	1.7	96.8	—	1,067
11期(2019年5月8日)	12,144	0	1.2	454.86	1.7	97.7	—	877
12期(2020年5月8日)	12,545	0	3.3	470.28	3.4	97.1	—	754
13期(2021年5月10日)	13,392	0	6.8	502.97	6.9	98.4	—	3,168

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

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) ベンチマークは、基準価額への反映を考慮して前営業日（現地ベース）の値を用いております。小数点第3位を四捨五入しています（以下同じ）。

(注4) FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します（以下同じ）。

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債券 組入比率	債券 先物比率
	円	%	ポイント	%		
(期首) 2020年5月8日	12,545	—	470.28	—	97.1	—
5月末	12,806	2.1	481.05	2.3	133.0	—
6月末	13,006	3.7	488.81	3.9	97.5	—
7月末	13,131	4.7	494.14	5.1	97.8	—
8月末	13,111	4.5	492.65	4.8	98.2	—
9月末	13,168	5.0	494.88	5.2	97.5	—
10月末	12,970	3.4	488.04	3.8	98.8	—
11月末	13,102	4.4	493.20	4.9	98.1	—
12月末	13,210	5.3	497.33	5.8	98.7	—
2021年1月末	13,190	5.1	496.21	5.5	98.3	—
2月末	13,069	4.2	494.15	5.1	98.1	—
3月末	13,356	6.5	501.12	6.6	97.7	—
4月末	13,350	6.4	502.93	6.9	97.9	—
(期末) 2021年5月10日	13,392	6.8	502.97	6.9	98.4	—

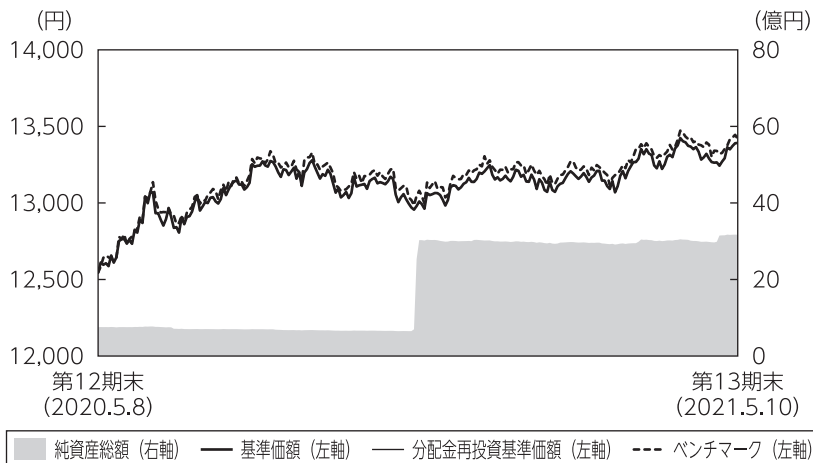
(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過 (2020年5月9日から2021年5月10日まで)

基準価額等の推移



第13期首：12,545円
第13期末：13,392円
(既払分配金0円)
騰落率：6.8%
(分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

為替市場で円安が進行したことなどから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

海外債券市場は下落しました。米国国債市場では、新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により米景気回復が加速するとの見方や、F R B（米連邦準備制度理事会）は金利上昇をさほど警戒していないとの見方、インフレ加速観測の高まりなどを背景に下落しました。また、ドイツ国債市場についても、リスク選好の動きやイタリアの政局を巡る不透明感の後退、米金利上昇などを受けて下落しました。

為替市場（対円）は、円安となりました。

米ドルは、F R Bの平均インフレ目標導入等の新政策を受けて軟調に推移していましたが、新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により景気回復が加速するとの見方から反転し、期を通じては上昇しました。

ユーロは、E C B（欧州中央銀行）の追加金融緩和策やE U（欧州連合）の欧州復興基金が域内景気を下支えするとの見方、ユーロ圏経済指標の改善などから上昇しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

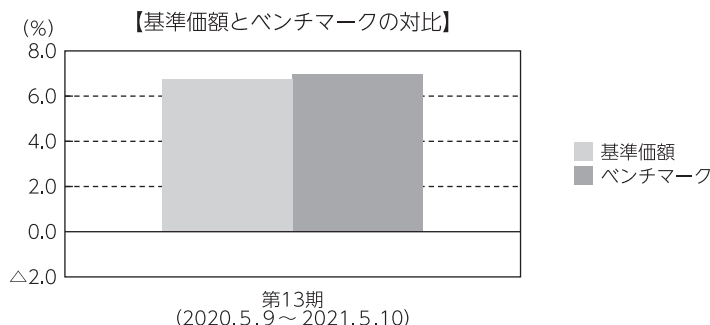
MH A M外国債券インデックスマザーファンド受益証券を高位に組み入れました。

●MH A M外国債券インデックスマザーファンド

F T S E世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行いました。期を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドの基準価額騰落率は為替レートの差異を考慮するとベンチマークを約0.1%下回りました。この差異は信託報酬や取引コストなどによるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年5月9日 ～2021年5月10日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	4,924円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券を高位に組み入れます。

●MHAM外国債券インデックスマザーファンド

F T S E世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行います。債券の組入比率は高位を目指します。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第13期		項目の概要
	(2020年5月9日 ～2021年5月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	21円	0.161%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,117円です。
(投信会社)	(14)	(0.103)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(1)	(0.011)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(6)	(0.046)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	3	0.027	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.021)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	24	0.188	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

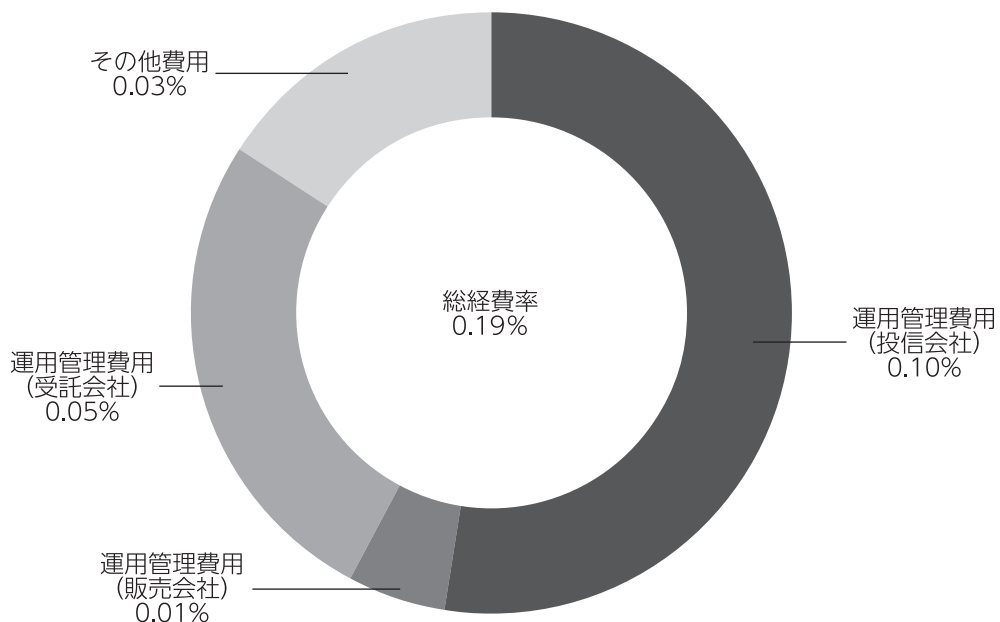
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.19%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年5月9日から2021年5月10日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	千口 1,986,785	千円 2,700,969	千口 302,276	千円 414,810

■利害関係人との取引状況等（2020年5月9日から2021年5月10日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	千口 576,006	千口 2,260,516	千円 3,168,792

■投資信託財産の構成

2021年5月10日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	千円 3,168,792	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,304	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	3,177,096	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末のMHAM外国債券インデックスマザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、28,678,038千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年5月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.77円、1カナダ・ドル=89.73円、1オーストラリア・ドル=85.44円、1シンガポール・ドル=82.08円、1イギリス・ポンド=152.65円、1イスラエル・シェケル=33.468円、1デンマーク・クローネ=17.79円、1ノルウェー・クローネ=13.26円、1スウェーデン・クローナ=13.10円、1メキシコ・ペソ=5.462円、1マレーシア・リングギット=26.524円、1ポランド・ズロチ=29.055円、1ユーロ=132.32円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年5月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,177,096,546円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,569,298
MHAM外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	3,168,792,248
未 収 入 金	5,735,000
(B) 負 債	8,204,490
未 払 解 約 金	6,244,868
未 払 信 託 報 酬	1,905,210
そ の 他 未 払 費 用	54,412
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	3,168,892,056
元 本	2,366,323,287
次 期 繰 越 損 益 金	802,568,769
(D) 受 益 権 総 口 数	2,366,323,287口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	13,392円

(注) 期首における元本額は601,762,263円、当期中における追加設定元本額は2,135,016,581円、同解約元本額は370,455,557円です。

■損益の状況

当期 自2020年5月9日 至2021年5月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△166円
受 取 利 息	5
支 払 利 息	△171
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	115,194,319
売 買 益	127,060,225
売 買 損	△11,865,906
(C) 信 託 報 酬 等	△3,054,095
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	112,140,058
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,120,662
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	681,308,049
(配 当 等 相 当 額)	(1,039,705,551)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△358,397,502)
(G) 合 計 (D+E+F)	802,568,769
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	802,568,769
追 加 信 託 差 損 益 金	681,308,049
(配 当 等 相 当 額)	(1,044,031,136)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△362,723,087)
分 配 準 備 積 立 金	121,260,720

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	34,517,419円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	56,958,711
(c) 収 益 調 整 金	1,044,031,136
(d) 分 配 準 備 積 立 金	29,784,590
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	1,165,291,856
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	4,924.48
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額の水準や市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■信託報酬を年率0.115% (税込み0.1265%) に引き下げる所要の約款変更を行いました。

(2020年10月1日)

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2021年5月10日）

（計算期間 2020年5月9日～2021年5月10日）

MHAM外国債券インデックスマザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2008年6月3日から無期限です。
運用方針	F T S E 世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、ベンチマークであるF T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。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。
主要投資対象	F T S E 世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率	ポイント	期中 騰落率			
9期(2017年5月8日)	12,279	1.9	439.54	2.5	98.1	—	11,560
10期(2018年5月8日)	12,444	1.3	447.08	1.7	96.9	—	15,932
11期(2019年5月8日)	12,641	1.6	454.86	1.7	97.7	—	23,076
12期(2020年5月8日)	13,103	3.7	470.28	3.4	97.2	—	15,441
13期(2021年5月10日)	14,018	7.0	502.97	6.9	98.4	—	28,690

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークは、基準価額への反映を考慮して前営業日（現地ベース）の値を用いております。小数点第3位を四捨五入しています（以下同じ）。

(注3) F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

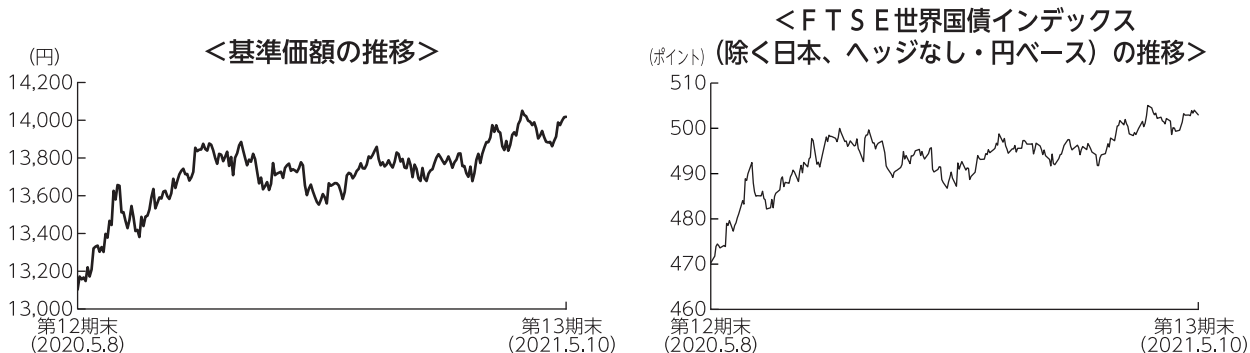
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2020年 5 月 8 日	円 13,103	% -	ポイント 470.28	% -	% 97.2	% -
5 月末	13,378	2.1	481.05	2.3	133.0	-
6 月末	13,591	3.7	488.81	3.9	97.5	-
7 月末	13,726	4.8	494.14	5.1	97.8	-
8 月末	13,709	4.6	492.65	4.8	98.2	-
9 月末	13,773	5.1	494.88	5.2	97.5	-
10 月末	13,567	3.5	488.04	3.8	98.8	-
11 月末	13,707	4.6	493.20	4.9	98.1	-
12 月末	13,821	5.5	497.33	5.8	98.7	-
2021年 1 月末	13,802	5.3	496.21	5.5	98.3	-
2 月末	13,677	4.4	494.15	5.1	98.1	-
3 月末	13,979	6.7	501.12	6.6	97.7	-
4 月末	13,974	6.6	502.93	6.9	97.9	-
(期 末) 2021年 5 月10日	14,018	7.0	502.97	6.9	98.4	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過 (2020年5月9日から2021年5月10日まで)



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は14,018円となり、前期末比で約7.0%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場で円安が進行したことなどから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

海外債券市場は下落しました。米国国債市場では、新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により米景気回復が加速するとの見方や、F R B (米連邦準備制度理事会) は金利上昇をさほど警戒していないとの見方、インフレ加速観測の高まりなどを背景に下落しました。また、ドイツ国債市場についても、リスク選好の動きやイタリアの政局を巡る不透明感の後退、米金利上昇などを受けて下落しました。

為替市場 (対円) は、円安となりました。

米ドルは、F R Bの平均インフレ目標導入等の新政策を受けて軟調に推移していましたが、新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により景気回復が加速するとの見方から反転し、期を通じては上昇しました。

ユーロは、E C B (欧州中央銀行) の追加金融緩和策やE U (欧州連合) の欧州復興基金が域内景気を下支えるとの見方、ユーロ圏経済指標の改善などから上昇しました。

ポートフォリオについて

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行いました。期を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドの基準価額騰落率はベンチマークを約0.1%上回りました。この差異は、ファンドとベンチマークの為替レートの差異などによるものです。

今後の運用方針

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行います。債券の組入比率は高位を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他費用 (保管費用)	3円	0.024%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(3)	(0.021)	
合計	(0)	(0.003)	
合計	3	0.024	
期中の平均基準価額は13,720円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2020年5月9日から2021年5月10日まで)

公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 98,933	千アメリカ・ドル 45,611 (-)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 5,765	千カナダ・ドル 2,641 (-)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 8,497	千オーストラリア・ドル 4,869 (-)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,032	千シンガポール・ドル 304 (-)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 10,022	千イギリス・ポンド 4,335 (-)
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 2,983	千イスラエル・シケル 541 (-)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 5,796	千デンマーク・クローネ 2,356 (-)
	国	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 4,007
スウェーデン		国債証券	千スウェーデン・クローナ 5,867	千スウェーデン・クローナ 1,966 (-)

			買付額	売付額
外	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 27,724	千メキシコ・ペソ 9,543 (-)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 4,168	千マレーシア・リンギット 1,801 (-)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 4,261	千ポーランド・ズロチ 1,342 (-)
国	ユ ー ロ 区	アイルランド	千ユーロ 2,772	千ユーロ 1,876 (-)
		オランダ	3,460	1,737 (-)
		ベルギー	4,448	2,586 (-)
		フランス	18,084	8,333 (-)
		ドイツ	14,432	7,106 (-)
		スペイン	12,113	6,365 (-)
		イタリア	16,768	8,422 (-)
		フィンランド	1,300	697 (-)
		オーストリア	3,120	1,552 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2020年5月9日から2021年5月10日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	未		
		評 価 額				残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 110,720	千アメリカ・ドル 114,629	千円 12,468,291	% 43.5	% -	% 18.9	% 17.7	% 6.8
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 6,220	千カナダ・ドル 6,504	千円 583,651	2.0	-	0.9	0.8	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 7,045	千オーストラリア・ドル 7,482	千円 639,323	2.2	-	1.5	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 1,340	千シンガポール・ドル 1,466	千円 120,383	0.4	-	0.3	0.1	-
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 10,034	千イギリス・ポンド 12,128	千円 1,851,484	6.5	-	4.9	1.3	0.2
イ ス ラ エ ル	千イスラエル・シユケル 3,150	千イスラエル・シユケル 3,507	千円 117,374	0.4	-	0.2	0.1	0.1
デ ン マ ー ク	千デンマーク・クローネ 6,370	千デンマーク・クローネ 7,777	千円 138,360	0.5	-	0.3	0.1	-
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェー・クローネ 5,150	千ノルウェー・クローネ 5,316	千円 70,498	0.2	-	0.1	0.1	-
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデン・クローナ 6,490	千スウェーデン・クローナ 7,067	千円 92,588	0.3	-	0.2	0.1	-
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 37,983	千メキシコ・ペソ 40,769	千円 222,704	0.8	-	0.4	0.3	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシア・リンギット 4,750	千マレーシア・リンギット 5,031	千円 133,460	0.5	-	0.4	0.1	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 5,660	千ポーランド・ズロチ 6,086	千円 176,858	0.6	-	0.3	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	1,590	1,773	234,706	0.8	-	0.7	0.1	0.0
オ ラ ン ダ	3,600	4,203	556,236	1.9	-	1.3	0.5	0.1
ベルギー	4,240	5,059	669,511	2.3	-	1.8	0.5	0.1
フ ラ ン ス	19,135	22,398	2,963,715	10.3	-	6.7	2.9	0.7
ド イ ツ	14,030	16,346	2,162,911	7.5	-	4.6	2.3	0.6
ス ペ イ ン	11,150	13,126	1,736,832	6.1	-	3.9	1.8	0.3
イ タ リ ア	17,707	20,492	2,711,593	9.5	-	5.9	2.8	0.8
フィンランド	1,170	1,264	167,376	0.6	-	0.4	0.2	0.0
オーストラリア	2,665	3,174	420,109	1.5	-	0.9	0.5	0.0
合 計	-	-	千円 28,237,972	98.4	-	54.7	33.1	10.7

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国(外貨建)公社債銘柄別

銘柄	種類	利率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	280	304	33,162	2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	520	558	60,784	2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	360	379	41,283	2024/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	660	700	76,199	2024/01/31
US T N/B 2.375 01/31/23	国債証券	2.3750	540	561	61,025	2023/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24	国債証券	0.1250	800	797	86,747	2024/01/15
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	490	506	55,046	2025/01/31
US T N/B 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	730	730	79,402	2023/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	690	670	72,925	2028/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	800	786	85,595	2026/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	260	324	35,314	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	180	209	22,839	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	250	291	31,679	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	380	397	43,271	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	110	134	14,628	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	120	154	16,855	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	160	216	23,525	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	200	268	29,228	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	160	229	24,991	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	330	415	45,163	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	560	646	70,297	2049/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	50	67	7,321	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	140	196	21,404	2040/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	680	621	67,572	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	710	739	80,460	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	340	356	38,762	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	400	459	49,935	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	710	816	88,852	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	710	759	82,566	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	740	781	85,029	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	720	788	85,717	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	710	782	85,109	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	1,290	1,332	144,988	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	560	600	65,310	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	350	368	40,065	2024/02/29
US T N/B 1.5 02/28/23	国債証券	1.5000	840	860	93,647	2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	370	400	43,601	2026/02/28
US T N/B 2.375 02/29/24	国債証券	2.3750	500	529	57,601	2024/02/29
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	250	261	28,419	2023/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	1,450	1,390	151,284	2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	850	811	88,247	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	750	706	76,870	2050/02/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	760	761	82,800	2030/02/15
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	800	797	86,740	2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	610	624	67,912	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	800	796	86,604	2028/02/29
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	870	860	93,554	2026/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	760	800	87,037	2024/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	310	318	34,593	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	240	259	28,230	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	430	461	50,147	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	330	344	37,505	2023/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	400	391	42,576	2027/03/31
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	700	699	76,112	2024/03/15
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	560	559	60,868	2025/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	700	701	76,317	2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	700	699	76,121	2026/03/31
US T N/B 0.125 03/31/23	国債証券	0.1250	1,200	1,199	130,493	2023/03/31
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	470	513	55,868	2025/04/30
US T N/B 1.75 04/30/22	国債証券	1.7500	180	182	19,896	2022/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	360	378	41,121	2024/04/30
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	320	329	35,822	2023/04/30
US T N/B 1.875 04/30/22	国債証券	1.8750	200	203	22,137	2022/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	300	323	35,203	2026/04/30
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	230	241	26,301	2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	670	708	77,086	2024/04/30
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	370	358	39,020	2027/04/30
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	560	556	60,519	2025/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	49	68	7,504	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	110	150	16,357	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	110	151	16,455	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	100	114	12,439	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	140	187	20,379	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	690	773	84,080	2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	300	363	39,548	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	220	251	27,351	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	330	378	41,212	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	320	335	36,465	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	560	659	71,713	2048/05/15
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	250	254	27,656	2022/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	660	553	60,257	2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	570	642	69,915	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	60	81	8,916	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	890	918	99,928	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	650	693	75,389	2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	630	669	72,858	2025/05/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	810	899	97,884	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	660	710	77,228	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	810	874	95,090	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	55	78	8,538	2037/05/15
US T N/B 1.875 05/31/22	国債証券	1.8750	100	101	11,084	2022/05/31
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	730	760	82,708	2026/05/15
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	730	751	81,784	2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	360	378	41,171	2024/05/31
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	690	538	58,528	2050/05/15
US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	1.7500	290	295	32,104	2022/05/31
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	300	319	34,803	2026/05/31
US T N/B 2.125 05/15/22	国債証券	2.1250	410	418	45,525	2022/05/15
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	530	558	60,721	2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	320	349	38,057	2025/05/31
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	710	687	74,734	2027/05/31
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	550	549	59,791	2023/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	870	804	87,510	2030/05/15
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	370	379	41,273	2023/06/30
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	290	305	33,200	2024/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	220	225	24,488	2022/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	250	272	29,614	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	430	453	49,296	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	530	557	60,679	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/22	国債証券	1.7500	260	264	28,819	2022/06/30
US T N/B 1.75 06/15/22	国債証券	1.7500	570	580	63,139	2022/06/15
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	560	541	58,867	2027/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	500	493	53,666	2025/06/30
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	380	401	43,705	2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	350	358	38,969	2023/07/31
US T N/B 2.0 07/31/22	国債証券	2.0000	250	255	27,838	2022/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	340	372	40,521	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	410	432	46,990	2026/07/31
US T N/B 1.875 07/31/22	国債証券	1.8750	290	296	32,244	2022/07/31
US T N/B 0.125 07/31/22	国債証券	0.1250	490	490	53,334	2022/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	500	478	52,052	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	730	719	78,235	2025/07/31
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	110	139	15,208	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	180	231	25,190	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	250	274	29,894	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	340	396	43,109	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	190	262	28,522	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	300	376	40,982	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	310	347	37,749	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	700	741	80,644	2025/08/15

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	360	395	42,985	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	580	577	62,800	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	750	789	85,863	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	690	735	79,979	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	430	429	46,666	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	540	622	67,676	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	690	739	80,413	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	640	661	71,937	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	700	778	84,657	2028/08/15
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	150	152	16,641	2022/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	490	534	58,133	2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	370	380	41,345	2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	580	589	64,156	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	210	214	23,378	2022/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	420	440	47,939	2024/08/31
US T N/B 1.625 08/31/22	国債証券	1.6250	790	805	87,667	2022/08/31
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	420	427	46,511	2022/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	660	551	60,030	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	830	668	72,720	2050/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	1,440	1,326	144,263	2030/08/15
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	430	442	48,101	2024/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	590	580	63,149	2025/08/31
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	900	898	97,770	2023/08/15
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	530	510	55,506	2027/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	340	375	40,794	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	480	508	55,280	2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	330	339	36,903	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	210	214	23,367	2022/09/30
US T N/B 1.875 09/30/22	国債証券	1.8750	720	737	80,266	2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	280	297	32,399	2023/09/30
US T N/B 0.125 09/30/22	国債証券	0.1250	910	910	99,027	2022/09/30
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	1,140	1,138	123,808	2023/09/15
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	520	495	53,940	2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	250	259	28,266	2026/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	720	707	76,995	2025/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	250	265	28,916	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	350	386	42,013	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	300	310	33,773	2023/10/31
US T N/B 2.0 10/31/22	国債証券	2.0000	320	329	35,785	2022/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	300	319	34,780	2023/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	360	373	40,659	2026/10/31
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	730	728	79,262	2023/10/15
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	560	580	63,164	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	660	633	68,905	2027/10/31

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	880	863	93,967	2025/10/31
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	270	308	33,544	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	190	256	27,893	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	256	281	30,579	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	260	302	32,933	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	360	460	50,110	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	330	362	39,431	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	890	764	83,195	2050/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	210	240	26,156	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	320	358	39,038	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	700	744	80,989	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	310	422	45,923	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	540	665	72,414	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	460	470	51,199	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	760	813	88,535	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	860	972	105,750	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	730	746	81,250	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	840	893	97,170	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	690	730	79,472	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	530	545	59,355	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	700	749	81,522	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	660	691	75,262	2023/11/30
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	280	296	32,269	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	360	395	43,045	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	600	640	69,672	2023/11/30
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	800	699	76,081	2040/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	510	523	56,898	2029/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	1,370	1,287	140,033	2030/11/15
US T N/B 0.25 11/15/23	国債証券	0.2500	800	800	87,107	2023/11/15
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	700	676	73,575	2027/11/30
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	620	643	69,963	2024/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	600	591	64,369	2025/11/30
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	280	294	32,067	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	470	499	54,336	2023/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	1,460	1,508	164,045	2022/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	370	386	42,052	2026/12/31
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	1,000	997	108,502	2023/12/15
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	290	303	33,005	2024/12/31
US T N/B 0.125 12/31/22	国債証券	0.1250	1,660	1,660	180,579	2022/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	800	787	85,703	2025/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	890	858	93,401	2027/12/31
小 計	—	—	110,720	114,629	12,468,291	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	390	409	36,783	2024/03/01

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	340	349	31,327	2023/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	200	204	18,374	2025/03/01
CANADA 1.5 05/01/22	国債証券	1.5000	540	546	49,075	2022/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	200	206	18,484	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	90	120	10,824	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	100	144	12,928	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	70	101	9,091	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	220	233	20,953	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	100	134	12,096	2041/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	110	112	10,139	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	300	307	27,588	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	140	147	13,263	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	310	329	29,587	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	290	289	25,952	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	120	128	11,566	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	390	383	34,443	2030/06/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	530	550	49,370	2023/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	150	151	13,599	2022/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	460	455	40,832	2025/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	110	141	12,725	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	190	218	19,585	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	460	452	40,566	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	40	47	4,236	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	370	337	30,252	2030/12/01
小 計	—	—	6,220	6,504	583,651	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	130	141	12,058	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	365	405	34,617	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	330	403	34,509	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	190	204	17,505	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	250	293	25,094	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	750	828	70,824	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	240	275	23,545	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	150	194	16,633	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	170	207	17,720	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	320	344	29,407	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	540	587	50,160	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	140	147	12,634	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	300	285	24,431	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	80	91	7,817	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	310	306	26,187	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	120	131	11,219	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	250	204	17,468	2051/06/21

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	290	285	24,408	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	200	222	18,980	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	200	221	18,942	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	290	321	27,470	2029/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	410	383	32,747	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	300	295	25,254	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	310	309	26,447	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	410	388	33,234	2030/12/21
小 計	—	—	7,045	7,482	639,323	—
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	150	155	12,793	2024/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	140	158	13,042	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	80	92	7,626	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	50	50	4,113	2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	40	45	3,760	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	140	152	12,531	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	100	106	8,760	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	120	127	10,432	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	80	89	7,311	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	30	32	2,652	2039/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	100	105	8,658	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	90	97	7,961	2024/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	120	134	11,031	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	100	118	9,705	2033/09/01
小 計	—	—	1,340	1,466	120,383	—
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	250	346	52,953	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	220	319	48,797	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	130	241	36,928	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	190	209	32,044	2049/01/22
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	60	54	8,286	2046/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	400	400	61,081	2024/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	200	198	30,264	2026/01/30
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	265	313	47,914	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	210	300	45,903	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	370	379	57,998	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	200	270	41,302	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	190	193	29,518	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	220	229	35,039	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	130	212	32,425	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	300	344	52,540	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	170	246	37,637	2065/07/22

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	180	332	50,758	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	170	180	27,510	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	300	314	48,034	2027/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	330	335	51,190	2023/07/22
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	120	112	17,188	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	310	289	44,166	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	180	270	41,366	2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	400	420	64,224	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	150	163	24,903	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	100	107	16,448	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	160	229	34,994	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	310	336	51,382	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	380	388	59,348	2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	140	152	23,343	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	130	100	15,402	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	90	108	16,500	2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	310	308	47,138	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	240	200	30,569	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	200	215	32,891	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	220	223	34,081	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	290	278	42,568	2030/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	120	167	25,636	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	200	314	48,016	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	215	346	52,936	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	200	328	50,147	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	242	445	67,952	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	330	410	62,707	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	180	274	41,977	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	175	239	36,524	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	157	268	40,934	2049/12/07
小 計	—	—	10,034	12,128	1,851,484	—
(イスラエル)		%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	200	314	10,536	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	280	355	11,885	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	340	365	12,232	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	400	439	14,708	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	400	394	13,204	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	400	430	14,402	2023/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	300	282	9,469	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	370	389	13,048	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	220	286	9,596	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	国債証券	1.5000	240	247	8,291	2023/11/30
小 計	—	—	3,150	3,507	117,374	—

銘柄	当 期 末					
	種類	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	420	389	6,933	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	1,510	2,664	47,396	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	1,070	1,177	20,950	2025/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	1,060	1,115	19,845	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	970	1,020	18,145	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	1,340	1,410	25,087	2029/11/15
小 計	—	—	6,370	7,777	138,360	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	630	646	8,572	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	500	518	6,881	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	700	746	9,898	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	490	507	6,726	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	530	558	7,404	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	900	928	12,306	2023/05/24
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	350	350	4,653	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	500	518	6,868	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	550	541	7,186	2031/09/17
小 計	—	—	5,150	5,316	70,498	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	620	907	11,882	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	1,050	1,094	14,331	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	1,050	1,163	15,239	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	600	584	7,655	2031/05/12
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	1,630	1,703	22,313	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	870	918	12,030	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	670	697	9,134	2029/11/12
小 計	—	—	6,490	7,067	92,588	—
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	3,789	3,771	20,599	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	3,552	3,670	20,048	2023/03/09
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	3,050	3,437	18,779	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	2,000	2,149	11,743	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	3,475	3,717	20,308	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	2,434	2,480	13,549	2022/06/09
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	2,350	2,531	13,829	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	2,544	2,576	14,076	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	2,657	2,743	14,985	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	2,009	2,211	12,082	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	1,911	2,407	13,150	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	1,315	1,397	7,635	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	3,826	4,383	23,946	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	3,071	3,289	17,968	2023/12/07
小 計	—	—	37,983	40,769	222,704	—

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評 価 額	額	
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	250	263	6,996	2046/03/15
MALAYSIA 3.882 03/14/25	国債証券	3.8820	300	315	8,377	2025/03/14
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	400	438	11,628	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	250	251	6,671	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	300	323	8,577	2037/04/07
MALAYSIA 3.757 04/20/23	国債証券	3.7570	200	206	5,472	2023/04/20
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	300	312	8,294	2035/05/31
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	400	426	11,307	2031/06/30
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	370	401	10,636	2038/06/08
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	400	421	11,175	2029/08/15
MALAYSIA 3.8 08/17/23	国債証券	3.8000	180	186	4,948	2023/08/17
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	430	455	12,070	2025/09/15
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	440	468	12,419	2026/11/30
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	530	561	14,882	2027/11/16
小 計	—	—	4,750	5,031	133,460	—
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	480	499	14,522	2023/01/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	590	647	18,822	2028/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	460	489	14,224	2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	610	659	19,169	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	560	619	17,998	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	400	432	12,572	2027/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	330	356	10,344	2022/09/23
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	700	766	22,272	2023/10/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	700	767	22,301	2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	490	520	15,114	2024/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	340	327	9,516	2030/10/25
小 計	—	—	5,660	6,086	176,858	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	90	114	15,120	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	90	100	13,363	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	60	66	8,841	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	170	208	27,629	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	60	65	8,607	2023/03/20
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	80	91	12,156	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	50	55	7,405	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	110	133	17,671	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	100	107	14,236	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	120	131	17,345	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	180	192	25,490	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	120	142	18,795	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	40	39	5,276	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	110	113	14,976	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	70	68	9,081	2031/10/18

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評 価 額		
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	140	141	18,709	2030/10/18
小 計	—	—	1,590	1,773	234,706	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.5000	70	80	10,696	2023/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	200	341	45,141	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	190	303	40,136	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	100	87	11,608	2052/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	150	161	21,344	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	120	167	22,194	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	190	304	40,283	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	240	310	41,120	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	200	209	27,681	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	250	254	33,697	2024/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	250	256	33,906	2027/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	220	231	30,688	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	160	168	22,281	2026/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	210	228	30,171	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	330	341	45,214	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	160	172	22,818	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	220	235	31,218	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	130	135	17,896	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	150	152	20,138	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	60	60	7,997	2031/07/15
小 計	—	—	3,600	4,203	556,236	—
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	300	420	55,702	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	210	350	46,375	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	100	124	16,487	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	100	141	18,788	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	230	375	49,647	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	100	112	14,855	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	100	164	21,790	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	150	175	23,196	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	80	95	12,661	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	50	68	9,118	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	100	137	18,209	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	90	73	9,688	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	220	236	31,270	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	250	275	36,423	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	150	164	21,712	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	210	223	29,512	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	210	225	29,854	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	50	47	6,303	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	160	173	22,923	2029/06/22

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評 価 額	額	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	70	94	12,470	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	110	134	17,751	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	130	137	18,156	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	130	138	18,390	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	60	68	9,094	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	210	212	28,073	2030/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	150	160	21,210	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	180	186	24,716	2024/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	170	167	22,179	2031/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	100	102	13,509	2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	70	71	9,436	2027/10/22
小 計	-	-	4,240	5,059	669,511	-
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	400	408	53,993	2026/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	200	203	26,900	2024/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	500	508	67,310	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	500	510	67,483	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	540	546	72,325	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	120	141	18,743	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	580	694	91,929	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	470	812	107,505	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	250	469	62,084	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	250	490	64,941	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	540	783	103,708	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	460	737	97,526	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	300	463	61,382	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	320	408	54,004	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	370	425	56,334	2050/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	310	292	38,689	2052/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	160	199	26,405	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	110	83	11,101	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	480	521	69,055	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	590	723	95,794	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	600	640	84,770	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	590	672	89,043	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	500	520	68,898	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	510	534	70,694	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	460	513	67,956	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	490	512	67,853	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	450	486	64,307	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	160	155	20,571	2040/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	600	629	83,294	2023/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	530	591	78,292	2036/05/25
FRANCE OAT 05/25/22	国債証券	0.0000	530	533	70,601	2022/05/25

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評 価 額	額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	410	493	65,321	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	160	151	20,062	2044/06/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	665	745	98,651	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	370	478	63,328	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	600	718	95,118	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	290	458	60,686	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	350	572	75,713	2032/10/25
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	340	354	46,910	2022/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	570	617	81,658	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	420	448	59,312	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	540	558	73,888	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	530	566	74,928	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	580	576	76,248	2030/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	440	441	58,378	2029/11/25
小 計	-	-	19,135	22,398	2,963,715	-
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	70	83	11,000	2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	150	212	28,118	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	70	110	14,683	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	280	439	58,179	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	370	601	79,619	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	340	355	47,015	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	400	421	55,808	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	410	430	57,024	2029/02/15
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	310	322	42,632	2023/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	370	394	52,254	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	500	534	70,718	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	470	492	65,122	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	280	286	37,862	2031/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	330	339	44,877	2030/02/15
BUNDESobl 04/14/23	国債証券	0.0000	370	375	49,635	2023/04/14
BUNDESobl 04/05/24	国債証券	0.0000	350	357	47,263	2024/04/05
BUNDESobl 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	460	472	62,460	2025/04/11
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	310	330	43,778	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	470	491	64,994	2023/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	240	239	31,682	2035/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	140	201	26,714	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	210	290	38,383	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	190	333	44,167	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	200	329	43,629	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	420	639	84,622	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	300	566	74,935	2040/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	330	339	44,895	2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	360	593	78,466	2034/07/04

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評 価 額	額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	350	543	71,868	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	340	424	56,113	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	370	396	52,463	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	470	500	66,224	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	300	309	40,936	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	300	315	41,716	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	360	382	50,600	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	400	422	55,906	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	280	288	38,139	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	300	271	35,918	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	330	338	44,760	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	90	92	12,269	2030/08/15
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	330	339	44,939	2022/09/04
BUNDESobl 10/07/22	国債証券	0.0000	30	30	4,008	2022/10/07
BUNDESobl 10/13/23	国債証券	0.0000	440	447	59,253	2023/10/13
BUNDESobl 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	350	360	47,640	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	290	299	39,602	2027/11/15
小 計	-	-	14,030	16,346	2,162,911	-
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	320	463	61,279	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	300	343	45,449	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	210	311	41,254	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	290	319	42,321	2023/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	290	293	38,867	2025/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	330	355	47,049	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	280	315	41,774	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	270	295	39,086	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	260	288	38,116	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	200	218	28,891	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	330	362	47,904	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	130	131	17,360	2022/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	330	334	44,243	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	150	144	19,103	2031/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	360	474	62,830	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	270	447	59,234	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	300	492	65,192	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	180	274	36,258	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	365	442	58,495	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	310	354	46,899	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	295	461	61,124	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	220	262	34,714	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	270	294	39,016	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	250	283	37,568	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	230	235	31,096	2024/07/30

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評 価 額	額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	470	479	63,395	2023/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	350	367	48,683	2027/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	380	421	55,817	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	220	302	39,994	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	180	322	42,694	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	210	280	37,175	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	140	181	24,057	2048/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	60	52	6,903	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	310	276	36,534	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	330	366	48,448	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	200	218	28,930	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	270	291	38,575	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	250	256	33,950	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	330	370	49,015	2023/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	220	223	29,549	2022/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	210	211	27,980	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	280	302	39,991	2030/10/31
小 計	-	-	11,150	13,126	1,736,832	-
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	350	360	47,655	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	350	351	46,501	2024/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	250	378	50,016	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	370	502	66,534	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	360	395	52,341	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	300	303	40,201	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	210	213	28,212	2026/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	210	246	32,616	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	170	226	29,946	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	380	429	56,843	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	110	126	16,783	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	390	464	61,403	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	280	337	44,715	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	320	341	45,124	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	220	273	36,242	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	220	277	36,680	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	330	406	53,759	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	220	224	29,768	2023/03/15
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	220	223	29,517	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	180	184	24,377	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	180	168	22,233	2037/03/01
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	50	47	6,299	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	340	356	47,126	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	200	199	26,434	2031/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	310	460	60,991	2031/05/01

銘柄	当 期 末				償還年月日	
	種類	利率	額面金額	評 価 額		
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	590	646	85,479	2023/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	200	211	28,028	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	230	242	32,129	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	260	277	36,773	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	290	306	40,613	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	220	243	32,271	2027/06/01
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	210	230	30,438	2026/07/15
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	国債証券	1.0000	140	142	18,828	2022/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	240	257	34,046	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	350	509	67,397	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	270	419	55,472	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	490	544	72,098	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	300	329	43,663	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	280	331	43,824	2029/08/01
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	180	182	24,188	2022/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	200	193	25,555	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	180	181	24,072	2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	300	303	40,168	2023/08/15
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	160	195	25,913	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	240	377	49,897	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	270	347	45,935	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	260	337	44,610	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	280	437	57,919	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	210	233	30,960	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	120	113	14,960	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	210	241	31,894	2033/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	260	292	38,746	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	190	270	35,820	2049/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	170	183	24,217	2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	170	190	25,204	2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	160	163	21,682	2022/09/15
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	250	257	34,131	2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	300	306	40,545	2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	340	361	47,866	2023/10/01
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	80	98	13,000	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	60	82	10,938	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	300	415	54,994	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	390	535	70,796	2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	130	141	18,678	2022/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	210	220	29,232	2024/11/15
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	200	221	29,286	2025/11/15
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	230	249	33,008	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	300	315	41,767	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	267	290	38,493	2024/12/01

銘柄	当 期 末					償還年月日
	種類	利率	額面金額	評 価 額	額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	240	278	36,863	2028/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	260	278	36,843	2030/12/01
小 計	-	-	17,707	20,492	2,711,593	-
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券	0.1250	30	25	3,416	2052/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	50	53	7,101	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	40	48	6,380	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	150	157	20,825	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	60	67	8,873	2034/04/15
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	100	104	13,789	2023/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	50	48	6,425	2036/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	50	59	7,884	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	100	122	16,143	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	50	72	9,530	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	80	84	11,149	2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	50	53	7,026	2025/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	40	42	5,583	2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	130	137	18,143	2027/09/15
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	100	101	13,439	2023/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	50	48	6,353	2040/09/15
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	40	40	5,309	2030/09/15
小 計	-	-	1,170	1,264	167,376	-
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	40	82	10,919	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	80	97	12,871	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	110	115	15,342	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	130	139	18,444	2028/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	80	79	10,565	2031/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	100	100	13,327	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	120	151	20,070	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	210	335	44,362	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	50	51	6,766	2051/03/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	140	147	19,523	2027/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	130	167	22,116	2034/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	30	27	3,575	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	120	190	25,144	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	85	120	15,903	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	140	141	18,782	2023/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	80	130	17,235	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	250	269	35,690	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	170	181	23,966	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	190	204	27,092	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	290	307	40,640	2023/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	30	38	5,110	2086/11/02

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評 価 額	額	
(ユーロ…オーストリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.4 11/22/22		国債証券	3.4000	90	95	12,656	2022/11/22
小	計	—	—	2,665	3,174	420,109	—
合	計	—	—	—	—	28,237,972	—

■投資信託財産の構成

2021年5月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 28,237,972	% 98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	461,731	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	28,699,704	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、28,678,038千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年5月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.77円、1カナダ・ドル=89.73円、1オーストラリア・ドル=85.44円、1シンガポール・ドル=82.08円、1イギリス・ポンド=152.65円、1イスラエル・シケル=33.468円、1デンマーク・クローネ=17.79円、1ノルウェー・クローネ=13.26円、1スウェーデン・クローナ=13.10円、1メキシコ・ペソ=5.462円、1マレーシア・リンギット=26.524円、1ポランド・ズロチ=29.055円、1ユーロ=132.32円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年5月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	28,699,704,454円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	230,190,419
公 社 債(評価額)	28,237,972,522
未 収 利 息	148,692,441
前 払 費 用	33,192,748
差 入 委 託 証 拠 金	49,656,324
(B) 負 債	8,800,959
未 払 金	1,729,959
未 払 解 約 金	7,071,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	28,690,903,495
元 本	20,467,607,621
次 期 繰 越 損 益 金	8,223,295,874
(D) 受 益 権 総 口 数	20,467,607,621口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,018円

(注1) 期首元本額 11,785,412,583円
追加設定元本額 15,452,470,988円
一部解約元本額 6,770,275,950円

(注2) 期末における元本の内訳
動的パッケージファンド<DC年金> 84,984,294円
コア資産形成ファンド 68,714,955円
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ) 2,260,516,656円
MHAM外国債券インデックスファンド<海智ヘッジあり>(ファンドラップ) 519,336,129円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定] 12,404,352,533円
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定] 5,129,703,054円
期末元本合計 20,467,607,621円

■損益の状況

当期 自2020年5月9日 至2021年5月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	460,216,798円
受 取 利 息	460,252,728
そ の 他 収 益 金	16,184
支 払 利 息	△52,114
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,047,864,497
売 買 益	2,238,630,814
売 買 損	△1,190,766,317
(C) そ の 他 費 用	△5,552,176
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,502,529,119
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,656,520,293
(F) 解 約 差 損 益 金	△2,518,890,750
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,583,137,212
(H) 合 計(D+E+F+G)	8,223,295,874
次 期 繰 越 損 益 金(H)	8,223,295,874

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。