

運用報告書 (全体版)

第8期<決算日2023年5月8日>

MHAM外国債券インデックスファンド <為替ヘッジあり> (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	2015年10月19日から無期限です。	
運用方針	FTSE世界国債インデックス (除く日本) に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・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<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
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、為替変動リスクの低減を図ります。	
組入制限	MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>(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。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	外貨建資産への投資には、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<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)」は、2023年5月8日に第8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<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		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	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
4期(2019年5月8日)	10,014	0	1.7	10,312.56	2.4	96.0	-	1,254
5期(2020年5月8日)	10,769	0	7.5	11,155.20	8.2	95.9	-	1,338
6期(2021年5月10日)	10,494	0	△2.6	10,907.16	△2.2	98.5	-	727
7期(2022年5月9日)	9,458	0	△9.9	9,839.01	△9.8	94.1	-	499
8期(2023年5月8日)	8,895	0	△6.0	9,261.34	△5.9	98.1	-	23,947

(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の値を用いて、設定日(2015年10月19日)を10,000として指数化しております(小数点第3位を四捨五入)(以下同じ)。

(注4) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・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投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(円ベースの指数)で、対円での為替ヘッジコストが考慮されています。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、円ヘッジ・円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%
2022年5月9日	9,458	-	9,839.01	-	94.1	-
5月末	9,567	1.2	9,959.31	1.2	98.3	-
6月末	9,315	△1.5	9,690.37	△1.5	102.8	-
7月末	9,585	1.3	9,980.04	1.4	97.1	-
8月末	9,263	△2.1	9,628.75	△2.1	102.1	-
9月末	8,874	△6.2	9,225.42	△6.2	101.7	-
10月末	8,854	△6.4	9,207.83	△6.4	101.8	-
11月末	8,984	△5.0	9,341.49	△5.1	94.4	-
12月末	8,807	△6.9	9,158.91	△6.9	96.4	-
2023年1月末	8,940	△5.5	9,307.08	△5.4	99.9	-
2月末	8,732	△7.7	9,084.85	△7.7	99.8	-
3月末	8,880	△6.1	9,243.90	△6.0	98.3	-
4月末	8,841	△6.5	9,206.05	△6.4	100.4	-
(期末)						
2023年5月8日	8,895	△6.0	9,261.34	△5.9	98.1	-

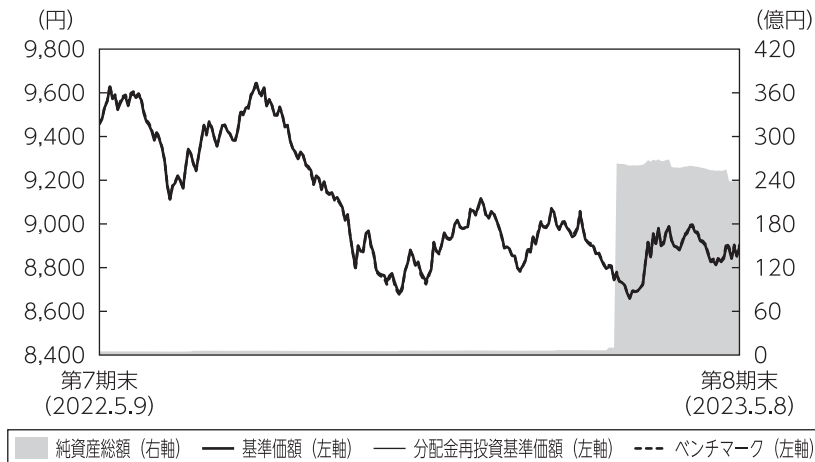
(注1) 騰落率は期首比です。

(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 (2022年5月10日から2023年5月8日まで)

基準価額等の推移



第8期首： 9,458円
第8期末： 8,895円
(既払分配金0円)
騰落率： $\Delta 6.0\%$
(分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

インフレ率が加速する中で、主要国の中央銀行による複数回の利上げが行われたことから米国国債、ドイツ国債の利回りは上昇（価格は下落）しました。債券価格の下落を受けて基準価額は下落しました。

投資環境

米国国債、および、ドイツ国債の利回りはともに上昇しました。

米国国債は、インフレ率が加速する中でF O M C（米連邦公開市場委員会）の複数回の利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ国債についても米国国債の金利上昇やE C B（欧州中央銀行）の複数回の利上げを受けて利回りは上昇しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

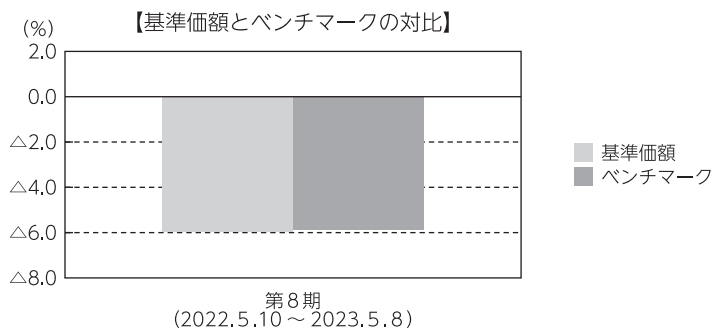
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを高位に組み入れ、実質組入外貨建て資産に対して対円での為替ヘッジを行いました。

●外国債券パッシブ・ファンド・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、円ベース、為替ヘッジなし）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。

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
	2022年5月10日 ～2023年5月8日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	1,482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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを高位に組み入れ、実質組入外貨建て資産に対して対円での為替ヘッジを行います。

●外国債券パッシブ・ファンド・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、円ベース、為替ヘッジなし）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 8 期		項目の概要
	(2022年5月10日 ～2023年5月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	6円	0.066%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,082円です。
(投信会社)	(3)	(0.033)	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)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	2	0.017	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.014)	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)	(0.003)	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)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	8	0.083	

(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。

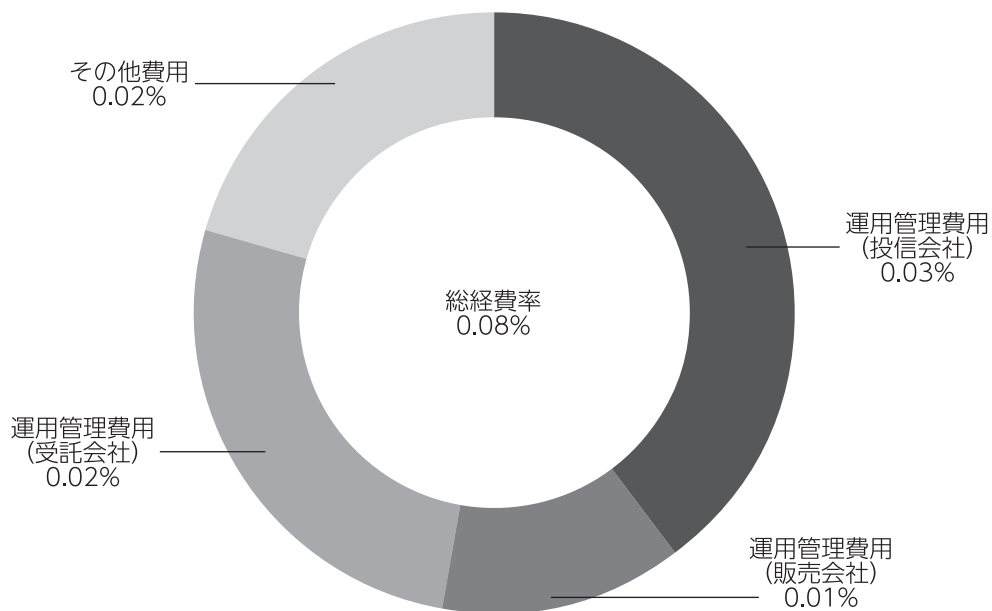
(注 2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.08%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（2022年5月10日から2023年5月8日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 13,110,931	千円 26,394,402	千口 2,062,018	千円 4,256,875

■利害関係人との取引状況等（2022年5月10日から2023年5月8日まで）

【MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %

【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %

平均保有割合 3.6%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期	末
	□ 数	□ 数	評 価 額
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 244,033	千口 11,292,945	千円 23,700,505

■投資信託財産の構成

2023年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	23,700,505	95.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,193,360	4.8
投 資 信 託 財 産 総 額	24,893,865	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) 期末の外国債券パッシブ・ファンド・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、215,662,994千円、98.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.14円、1カナダ・ドル=100.96円、1オーストラリア・ドル=91.14円、1シンガポール・ドル=101.92円、1ニュージーランド・ドル=85.12円、1イギリス・ポンド=170.68円、1イスラエル・シェケル=37.111円、1デンマーク・クローネ=19.99円、1ノルウェー・クローネ=12.79円、1スウェーデン・クローナ=13.29円、1メキシコ・ペソ=7.607円、1オフショア・人民元=19.511円、1マレーシア・リンギット=30.439円、1ポーランド・ズロチ=32.562円、1ユーロ=148.92円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	48,617,076,015円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	27,671,208
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド (評価額)	23,700,505,554
未 収 入 金	24,888,899,253
(B) 負 債	24,669,642,956
未 払 金	24,665,468,834
未 払 解 約 金	390,868
未 払 信 託 報 酬	3,611,097
そ の 他 未 払 費 用	172,157
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	23,947,433,059
元 本	26,921,960,341
次 期 繰 越 損 益 金	△ 2,974,527,282
(D) 受 益 権 総 口 数	26,921,960,341口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	8,895円

(注) 期首における元本額は528,521,719円、当期中における追加設定元本額は29,876,079,777円、同解約元本額は3,482,641,155円です。

■損益の状況

当期 自2022年5月10日 至2023年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△918円
受 取 利 息	41
支 払 利 息	△959
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	372,852,401
売 買 益	1,677,297,492
売 買 損	△1,304,445,091
(C) 信 託 報 酬 等	△4,149,682
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	368,701,801
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△30,919,658
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△3,312,309,425
(配 当 等 相 当 額)	(3,644,316,964)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△6,956,626,389)
(G) 合 計 (D+E+F)	△2,974,527,282
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	△2,974,527,282
追 加 信 託 差 損 益 金	△3,312,309,425
(配 当 等 相 当 額)	(3,652,757,211)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△6,965,066,636)
分 配 準 備 積 立 金	337,782,143

(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	126,143,883円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	180,239,476
(c) 収 益 調 整 金	3,652,757,211
(d) 分 配 準 備 積 立 金	31,398,784
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	3,990,539,354
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,482.26
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■信託報酬を年率0.06% (税込み0.066%) に引き下げる変更を行いました。

(2023年2月10日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第20期（決算日 2023年2月21日）

（計算期間 2022年2月22日～2023年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入率	債券先物率	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率			
16期 (2019年2月21日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2020年2月21日)	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
18期 (2021年2月22日)	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
19期 (2022年2月21日)	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
20期 (2023年2月21日)	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964
20期 (2023年2月21日)	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-	186,822

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

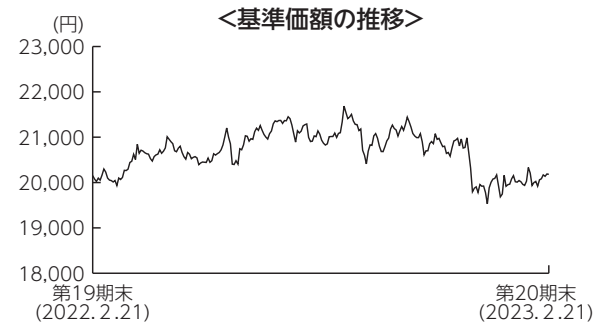
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022 年 2 月 21 日	円 20,152	% -	ポイント 126,280.23	% -	% 98.9	% -
2 月 末	20,052	△0.5	125,907.80	△0.3	98.8	-
3 月 末	20,713	2.8	129,775.21	2.8	98.3	-
4 月 末	20,758	3.0	129,955.37	2.9	99.0	-
5 月 末	20,634	2.4	129,451.47	2.5	98.7	-
6 月 末	21,122	4.8	132,579.22	5.0	99.0	-
7 月 末	21,267	5.5	133,117.57	5.4	98.9	-
8 月 末	21,015	4.3	131,430.25	4.1	98.7	-
9 月 末	20,830	3.4	130,076.63	3.0	99.0	-
10 月 末	21,443	6.4	134,355.57	6.4	99.0	-
11 月 末	20,802	3.2	130,450.40	3.3	98.7	-
12 月 末	19,782	△1.8	123,946.23	△1.8	98.6	-
2023 年 1 月 末	20,018	△0.7	125,559.33	△0.6	98.8	-
(期 末) 2023 年 2 月 21 日	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-

(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（2022年2月22日から2023年2月21日まで）

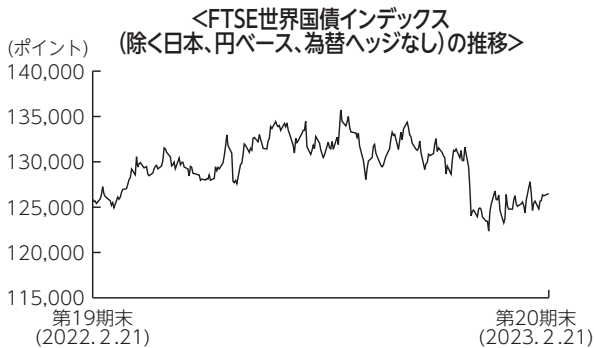


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,182円となり、前期末比で0.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

FOMC（米連邦公開市場委員会）による複数回の利上げやインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもFOMCによる複数回の利上げと日銀の金融緩和策を堅持する姿勢から、日米金利差拡大が意識されて円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも大きく為替が円安に動いたことから、基準価額は若干上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、インフレ率が加速する中でFOMCの複数回の利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についても米国債の金利上昇やECB（欧州中央銀行）の複数回の利上げを受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、FOMCにおいて複数回の利上げを実施しましたが、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

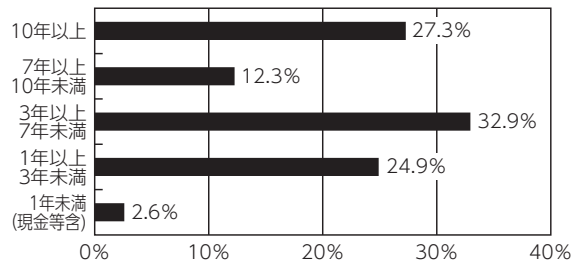
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

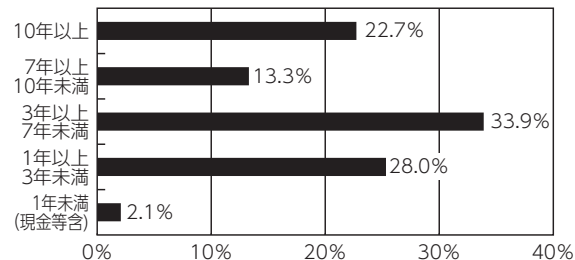
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	47.3%	48.0%	△0.7%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	49.3%	50.0%	△0.7%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.7%	△0.0%
計	0.7%	0.7%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	△0.0%
ベルギー	2.2%	2.2%	△0.0%
フィンランド	0.6%	0.6%	△0.0%
フランス	9.7%	9.8%	△0.1%
ドイツ	7.2%	7.2%	△0.0%
アイルランド	0.8%	0.8%	0.0%
イタリア	8.5%	8.7%	△0.2%
オランダ	1.8%	1.9%	△0.0%
スペイン	5.7%	5.7%	0.0%
ユーロ計	37.8%	38.2%	△0.4%
デンマーク	0.4%	0.4%	0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	△0.0%
英国	5.8%	5.5%	0.3%
ポーランド	0.5%	0.5%	0.0%
ノルウェー	0.2%	0.3%	△0.0%
計	45.0%	45.1%	△0.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.5%	1.6%	△0.0%
中国	0.9%	1.2%	△0.3%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
計	3.4%	3.7%	△0.3%
中近東			
イスラエル	0.4%	0.4%	△0.0%
計	0.4%	0.4%	△0.0%
現金など	1.1%	—	—
合計	100.0%	100.0%	—

期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	49.5%	50.0%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.1%	△0.0%
計	51.6%	52.0%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.9%	0.9%	△0.0%
計	0.9%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.9%	1.9%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.4%	8.4%	0.0%
ドイツ	6.5%	6.4%	0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.5%	7.6%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	5.0%	5.0%	△0.0%
ユーロ計	33.1%	33.2%	△0.1%
デンマーク	0.3%	0.3%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
英国	4.8%	4.7%	0.1%
ポーランド	0.4%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	39.0%	39.1%	△0.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.6%	1.6%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	4.4%	4.8%	△0.4%
シンガポール	0.5%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.6%	△0.0%
計	7.2%	7.6%	△0.4%
中近東			
イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など	1.0%	—	—
合計	100.0%	100.0%	—

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で0.2%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	3円 (3)	0.016% (0.015)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は20,688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 (2022年2月22日から2023年2月21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 536,386	千アメリカ・ドル 350,573	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 26,736	千カナダ・ドル 16,227	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 19,961	千オーストラリア・ドル 11,123	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 4,947	千シンガポール・ドル 3,149	
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 4,867	千ニュージーランド・ドル -	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 42,306	千イギリス・ポンド 23,277	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 9,417	千イスラエル・シケル 7,354	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 15,932	千デンマーク・クローネ 12,094	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 16,915	千ノルウェー・クローネ 14,888	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 13,712	千スウェーデン・クローナ 12,914	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 111,333	千メキシコ・ペソ 63,692	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 369,093	千オフショア・人民元 18,682	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 15,418	千マレーシア・リンギット 8,762	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 13,489	千ポーランド・ズロチ 7,291	
国	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 5,238	千ユーロ 3,823
		オランダ	国債証券	15,082	10,731
		ベルギー	国債証券	17,985	11,988
		フランス	国債証券	79,108	52,916
		ドイツ	国債証券	67,768	45,631
		スペイン	国債証券	46,170	31,229
		イタリア	国債証券	74,616	52,932
		フィンランド	国債証券	4,741	3,163
	オーストラリア	国債証券	12,167	8,398	

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等（2022年2月22日から2023年2月21日まで）

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
金 銭 信 託	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 774,590	千アメリカ・ドル 689,046	千円 92,552,791	% 49.5	% -	% 21.4	% 18.2	% 9.9	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 41,990	千カナダ・ドル 38,354	千円 3,827,785	2.0	-	1.1	0.6	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 35,405	千オーストラリア・ドル 31,922	千円 2,963,084	1.6	-	1.1	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 8,895	千シンガポール・ドル 8,486	千円 853,411	0.5	-	0.2	0.2	0.1	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 5,560	千ニュージーランド・ドル 4,858	千円 408,149	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 65,284	千イギリス・ポンド 55,908	千円 9,037,014	4.8	-	3.4	0.9	0.5	
イスラエル	千イスラエル・シケル 17,540	千イスラエル・シケル 16,376	千円 614,774	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 33,220	千デンマーク・クローネ 31,156	千円 600,381	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 29,010	千ノルウェー・クローネ 27,010	千円 354,646	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 29,770	千スウェーデン・クローナ 28,193	千円 366,227	0.2	-	0.1	0.1	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 234,607	千メキシコ・ペソ 217,394	千円 1,589,526	0.9	-	0.4	0.3	0.1	
中 国	千オフショア・人民元 419,720	千オフショア・人民元 419,249	千円 8,205,585	4.4	-	1.9	2.0	0.4	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 33,550	千マレーシア・リンギット 34,072	千円 1,032,254	0.6	-	0.4	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 32,170	千ポーランド・ズロチ 27,310	千円 826,099	0.4	-	0.1	0.2	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	9,450	8,192	1,175,166	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
オランダ	21,490	19,601	2,811,844	1.5	-	0.9	0.5	0.1	
ベルギー	26,630	24,128	3,461,253	1.9	-	1.3	0.4	0.1	
フランス	120,130	109,930	15,769,556	8.4	-	5.2	2.6	0.7	
ドイツ	91,020	84,475	12,118,072	6.5	-	3.4	2.0	1.1	
スペイン	69,860	64,753	9,288,912	5.0	-	2.8	1.5	0.7	
イタリア	106,807	97,750	14,022,270	7.5	-	4.2	2.3	1.0	
フィンランド	7,640	6,508	933,600	0.5	-	0.3	0.2	0.1	
オーストリア	17,370	15,259	2,188,922	1.2	-	0.6	0.4	0.1	
合 計	-	-	千円 185,001,333	99.0	-	50.1	33.3	15.7	

(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	当 種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		末 償還年月日
				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	2,460	2,346	315,144	2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	500	480	64,520	2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	710	691	92,923	2024/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	2,550	2,490	334,501	2024/01/31
US T N/B 0.875 01/31/24	国債証券	0.8750	200	192	25,837	2024/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	4,940	4,463	599,597	2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	3,969	533,182	2029/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	705	94,711	2025/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,739	502,279	2028/01/31
US T N/B 1.125 01/15/25	国債証券	1.1250	4,880	4,570	613,950	2025/01/15
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	3,700	3,302	443,558	2026/01/31
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	800	790	106,129	2026/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	400	418	56,275	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,860	1,635	219,679	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,740	1,516	203,634	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,770	1,358	182,433	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	500	476	64,069	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	860	947	127,274	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	400	431	57,917	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	830	918	123,374	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,527	205,189	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,310	2,790	374,852	2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	4,300	3,071	412,560	2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	636	85,440	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	890	969	130,285	2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,807	377,043	2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	4,920	3,221	432,653	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	2,890	2,674	359,252	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,310	1,781	239,230	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,960	1,644	220,856	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,223	298,606	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	2,090	2,043	274,533	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,939	260,547	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,330	4,011	538,848	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	3,370	3,174	426,418	2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,518	472,624	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,650	1,602	215,212	2024/02/29
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,164	290,721	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,891	254,052	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	7,890	6,465	868,443	2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	4,700	3,401	456,856	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,720	2,528	339,658	2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	7,280	6,208	833,960	2032/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	979	131,533	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	3,730	3,194	429,149	2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	3,610	3,306	444,114	2027/02/28
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	4,800	4,574	614,488	2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,782	373,724	2025/02/28

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	期		末															
									評			額	償													
									外	貨				建	金	額	額	還	年	月	日					
(アメリカ)					%	千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル	千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル	千	円			
US T N/B 1.5 02/29/24	国	債	証	券	1.5000	4,000				3,860		518,517													2024/02/29	
US T N/B 1.125 02/29/28	国	債	証	券	1.1250	3,860				3,351		450,202														2028/02/29
US T N/B 1.875 02/28/29	国	債	証	券	1.8750	4,000				3,551		477,024														2029/02/28
US T N/B 0.5 02/28/26	国	債	証	券	0.5000	5,170				4,618		620,325														2026/02/28
US T N/B 1.5 02/15/25	国	債	証	券	1.5000	4,550				4,282		575,202														2025/02/15
US T N/B 2.125 03/31/24	国	債	証	券	2.1250	3,340				3,241		435,345														2024/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国	債	証	券	2.6250	1,790				1,721		231,172														2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国	債	証	券	2.2500	1,300				1,224		164,418														2026/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国	債	証	券	0.6250	2,200				1,912		256,880														2027/03/31
US T N/B 0.25 03/15/24	国	債	証	券	0.2500	3,910				3,720		499,752														2024/03/15
US T N/B 0.5 03/31/25	国	債	証	券	0.5000	2,860				2,630		353,302														2025/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28	国	債	証	券	1.2500	3,610				3,148		422,881														2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26	国	債	証	券	0.7500	3,220				2,894		388,853														2026/03/31
US T N/B 2.375 03/31/29	国	債	証	券	2.3750	3,000				2,736		367,590														2029/03/31
US T N/B 2.25 03/31/24	国	債	証	券	2.2500	4,750				4,609		619,178														2024/03/31
US T N/B 2.5 03/31/27	国	債	証	券	2.5000	2,650				2,486		333,923														2027/03/31
US T N/B 1.75 03/15/25	国	債	証	券	1.7500	4,000				3,777		507,456														2025/03/15
US T N/B 2.875 04/30/25	国	債	証	券	2.8750	2,000				1,931		259,405														2025/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国	債	証	券	2.0000	4,720				4,567		613,484														2024/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国	債	証	券	2.3750	1,260				1,190		159,855														2026/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国	債	証	券	2.2500	3,300				3,194		429,092														2024/04/30
US T N/B 1.25 04/30/28	国	債	証	券	1.2500	4,010				3,491		468,917														2028/04/30
US T N/B 0.375 04/15/24	国	債	証	券	0.3750	4,140				3,935		528,671														2024/04/15
US T N/B 0.5 04/30/27	国	債	証	券	0.5000	2,370				2,043		274,492														2027/04/30
US T N/B 2.5 04/30/24	国	債	証	券	2.5000	4,010				3,895		523,179														2024/04/30
US T N/B 2.875 04/30/29	国	債	証	券	2.8750	3,000				2,815		378,184														2029/04/30
US T N/B 0.75 04/30/26	国	債	証	券	0.7500	3,700				3,314		445,169														2026/04/30
US T N/B 0.375 04/30/25	国	債	証	券	0.3750	2,560				2,341		314,469														2025/04/30
US T N/B 2.75 04/30/27	国	債	証	券	2.7500	3,000				2,840		381,552														2027/04/30
US T N/B 2.625 04/15/25	国	債	証	券	2.6250	3,000				2,882		387,156														2025/04/15
US T N/B 6.25 05/15/30	国	債	証	券	6.2500	759				869		116,791														2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国	債	証	券	4.3750	910				960		128,992														2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国	債	証	券	4.3750	230				243		32,641														2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国	債	証	券	3.0000	1,080				928		124,733														2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国	債	証	券	4.2500	950				990		133,106														2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国	債	証	券	2.8750	2,290				1,914		257,152														2043/05/15
US T N/B 2.375 05/15/51	国	債	証	券	2.3750	5,560				4,092		549,728														2051/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国	債	証	券	3.3750	1,430				1,287		172,974														2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国	債	証	券	3.0000	400				337		45,270														2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国	債	証	券	3.0000	1,620				1,358		182,510														2047/05/15
US T N/B 2.875 05/15/52	国	債	証	券	2.8750	4,510				3,701		497,215														2052/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国	債	証	券	2.5000	2,230				1,713		230,090														2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国	債	証	券	3.1250	2,830				2,430		326,521														2048/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国	債	証	券	1.1250	3,300				2,117		284,480														2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国	債	証	券	2.8750	3,300				2,715		364,751														2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国	債	証	券	4.5000	600				644		86,516														2038/05/15
US T N/B 2.25 05/15/41	国	債	証	券	2.2500	3,420				2,627		352,892														2041/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国	債	証	券	2.5000	5,100				4,950		664,909														2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国	債	証	券	2.1250	3,950				3,751		503,911														2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国	債	証	券	2.8750	4,860				4,593		617,044														2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国	債	証	券	2.3750	3,470				3,161		424,615														2029/05/15

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	額	期		末			
										評		価		額	償
										外	貨	建	金		
(アメリカ)					%	千	ア	メ	リ	カ	・	ド			
US T N/B 2.375 05/15/27	国	債	証	券	2.3750	4,430	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 5.0 05/15/37	国	債	証	券	5.0000	555	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.625 05/15/26	国	債	証	券	1.6250	3,670	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.0 05/31/24	国	債	証	券	2.0000	800	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.25 05/15/50	国	債	証	券	1.2500	3,870	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.125 05/31/26	国	債	証	券	2.1250	1,550	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.625 05/15/31	国	債	証	券	1.6250	9,240	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.875 05/31/25	国	債	証	券	2.8750	1,570	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 3.25 05/15/42	国	債	証	券	3.2500	3,760	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.875 05/15/32	国	債	証	券	2.8750	6,650	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.5 05/31/27	国	債	証	券	0.5000	1,980	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.25 05/31/28	国	債	証	券	1.2500	3,300	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.25 05/15/24	国	債	証	券	0.2500	7,500	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.625 05/15/30	国	債	証	券	0.6250	5,650	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.5 05/31/24	国	債	証	券	2.5000	4,180	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.625 05/31/27	国	債	証	券	2.6250	3,410	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.75 05/31/29	国	債	証	券	2.7500	3,300	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.75 05/31/26	国	債	証	券	0.7500	3,630	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.25 05/31/25	国	債	証	券	0.2500	3,890	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.75 05/15/25	国	債	証	券	2.7500	4,000	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.0 06/30/24	国	債	証	券	2.0000	290	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.75 06/30/25	国	債	証	券	2.7500	1,040	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.875 06/30/26	国	債	証	券	1.8750	1,880	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.75 06/30/24	国	債	証	券	1.7500	1,340	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.5 06/30/27	国	債	証	券	0.5000	2,780	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.25 06/30/28	国	債	証	券	1.2500	3,710	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.25 06/30/25	国	債	証	券	0.2500	3,500	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 3.25 06/30/27	国	債	証	券	3.2500	3,500	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.25 06/15/24	国	債	証	券	0.2500	3,780	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.875 06/30/26	国	債	証	券	0.8750	3,310	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 3.25 06/30/29	国	債	証	券	3.2500	3,000	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.875 06/15/25	国	債	証	券	2.8750	4,920	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.125 07/31/24	国	債	証	券	2.1250	380	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.875 07/31/25	国	債	証	券	2.8750	2,200	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.875 07/31/26	国	債	証	券	1.8750	2,000	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.75 07/31/24	国	債	証	券	1.7500	1,990	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.0 07/31/28	国	債	証	券	1.0000	3,770	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.375 07/31/27	国	債	証	券	0.3750	3,780	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.25 07/31/25	国	債	証	券	0.2500	3,800	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.625 07/31/29	国	債	証	券	2.6250	2,570	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.625 07/31/26	国	債	証	券	0.6250	3,900	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.75 07/31/27	国	債	証	券	2.7500	3,820	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 0.375 07/15/24	国	債	証	券	0.3750	4,000	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 3.0 07/31/24	国	債	証	券	3.0000	3,820	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 3.0 07/15/25	国	債	証	券	3.0000	3,200	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 3.75 08/15/41	国	債	証	券	3.7500	820	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 3.875 08/15/40	国	債	証	券	3.8750	1,290	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 2.75 08/15/42	国	債	証	券	2.7500	1,540	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 3.125 08/15/44	国	債	証	券	3.1250	2,090	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 4.5 08/15/39	国	債	証	券	4.5000	980	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 3.625 08/15/43	国	債	証	券	3.6250	1,470	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		

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 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,110	3,439	462,016	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,457	195,769	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	4,050	3,831	514,671	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,784	239,650	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	3,040	2,193	294,573	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	3,640	3,067	411,995	2052/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	4,610	4,444	596,962	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,070	1,506	202,297	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,810	2,360	317,078	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,922	526,825	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,730	3,404	457,331	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	4,530	4,273	573,981	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,759	236,357	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,960	3,448	463,216	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	820	783	105,289	2024/08/31
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,658	357,068	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	4,930	3,452	463,693	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	3,160	2,013	270,388	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,870	2,799	375,976	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	5,840	5,341	717,415	2032/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,130	6,636	891,362	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	6,340	5,024	674,950	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	998	134,165	2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,870	2,719	365,229	2024/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,242	435,570	2025/08/31
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	4,100	3,835	515,216	2024/08/15
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,200	429,932	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,611	350,731	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	2,950	2,616	351,465	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,938	394,652	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,957	397,289	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,784	508,341	2027/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,689	226,869	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	590	565	75,973	2024/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,310	2,801	376,311	2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,417	190,418	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	3,980	3,432	461,003	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,349	449,937	2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	4,310	4,091	549,611	2024/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	2,000	2,002	268,986	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	3,110	2,764	371,360	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,934	394,200	2025/09/15
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	2,000	1,866	250,758	2024/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	3,250	3,230	433,930	2029/09/30
US T N/B 4.25 09/30/24	国債証券	4.2500	2,200	2,181	292,958	2024/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	2,350	2,254	302,779	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,270	1,223	164,362	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	1,710	1,562	209,840	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,082	548,376	2028/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,760	2,614	351,231	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,108	417,485	2027/10/31

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	期		末															
									評			額	償													
									外	貨				建	金	額	額	還	年	月	日					
(アメリカ)					%	千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル	千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル	千	円			
US T N/B 1.125 10/31/26	国	債	証	券	1.1250	3,390				3,034		407,622													2026/10/31	
US T N/B 0.625 10/15/24	国	債	証	券	0.6250	4,000				3,739		502,314														2024/10/15
US T N/B 4.0 10/31/29	国	債	証	券	4.0000	2,000				2,003		269,059														2029/10/31
US T N/B 4.375 10/31/24	国	債	証	券	4.3750	2,070				2,056		276,239														2024/10/31
US T N/B 4.125 10/31/27	国	債	証	券	4.1250	3,940				3,947		530,223														2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国	債	証	券	0.2500	4,000				3,587		481,831														2025/10/31
US T N/B 4.25 10/15/25	国	債	証	券	4.2500	2,800				2,789		374,678														2025/10/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国	債	証	券	5.2500	850				903		121,383														2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国	債	証	券	6.1250	200				217		29,227														2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国	債	証	券	3.0000	1,560				1,317		177,027														2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国	債	証	券	4.2500	600				623		83,803														2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国	債	証	券	2.7500	1,556				1,277		171,593														2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国	債	証	券	3.1250	1,020				899		120,822														2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国	債	証	券	3.7500	1,460				1,396		187,573														2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国	債	証	券	2.7500	2,250				1,801		241,941														2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国	債	証	券	1.6250	4,780				2,935		394,308														2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51	国	債	証	券	1.8750	4,670				3,041		408,512														2051/11/15
US T N/B 4.0 11/15/52	国	債	証	券	4.0000	2,460				2,519		338,378														2052/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国	債	証	券	3.0000	860				724		97,267														2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国	債	証	券	2.8750	1,080				886		119,135														2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国	債	証	券	2.2500	3,080				2,954		396,785														2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国	債	証	券	4.3750	1,000				1,057		142,106														2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国	債	証	券	3.3750	3,200				2,883		387,345														2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国	債	証	券	2.3750	3,290				2,438		327,498														2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国	債	証	券	2.2500	3,620				3,423		459,875														2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国	債	証	券	3.1250	4,380				4,180		561,571														2028/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国	債	証	券	2.0000	2,830				2,616		351,452														2026/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国	債	証	券	2.2500	3,270				3,015		405,100														2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/24	国	債	証	券	2.1250	1,780				1,702		228,629														2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国	債	証	券	2.8750	1,360				1,307		175,567														2025/11/30
US T N/B 4.0 11/15/42	国	債	証	券	4.0000	1,200				1,196		160,705														2042/11/15
US T N/B 1.375 11/15/40	国	債	証	券	1.3750	3,190				2,120		284,839														2040/11/15
US T N/B 1.5 11/15/41	国	債	証	券	2.0000	4,250				3,102		416,683														2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国	債	証	券	1.6250	1,810				1,651		221,798														2026/11/30
US T N/B 4.125 11/15/32	国	債	証	券	4.1250	4,500				4,605		618,606														2032/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国	債	証	券	1.7500	2,050				1,797		241,409														2029/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31	国	債	証	券	1.3750	7,990				6,549		879,702														2031/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国	債	証	券	0.8750	8,280				6,665		895,296														2030/11/15
US T N/B 0.625 11/30/27	国	債	証	券	0.6250	3,900				3,324		446,539														2027/11/30
US T N/B 1.25 11/30/26	国	債	証	券	1.2500	3,700				3,322		446,256														2026/11/30
US T N/B 1.5 11/30/28	国	債	証	券	1.5000	4,000				3,484		468,084														2028/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国	債	証	券	0.3750	3,190				2,862		384,544														2025/11/30
US T N/B 3.875 11/30/29	国	債	証	券	3.8750	2,300				2,286		307,149														2029/11/30
US T N/B 0.75 11/15/24	国	債	証	券	0.7500	2,610				2,438		327,486														2024/11/15
US T N/B 3.875 11/30/27	国	債	証	券	3.8750	3,000				2,978		400,016														2027/11/30
US T N/B 4.5 11/15/25	国	債	証	券	4.5000	3,570				3,581		481,011														2025/11/15
US T N/B 4.5 11/30/24	国	債	証	券	4.5000	4,200				4,183		561,929														2024/11/30
US T N/B 2.625 12/31/25	国	債	証	券	2.6250	1,000				955		128,317														2025/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国	債	証	券	2.2500	3,000				2,871		385,645														2024/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国	債	証	券	1.7500	2,110				1,931		259,380														2026/12/31
US T N/B 1.25 12/31/26	国	債	証	券	1.2500	3,890				3,488		468,519														2026/12/31

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 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,990	1,887	253,493	2024/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,500	3,888	522,344	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,688	361,168	2025/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	3,320	2,823	379,294	2027/12/31
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	4,610	4,314	579,498	2024/12/15
US T N/B 4.0 12/15/25	国債証券	4.0000	4,140	4,104	551,371	2025/12/15
小計	—	—	774,590	689,046	92,552,791	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	200	193	19,261	2024/02/01
CANADA 3.75 02/01/25	国債証券	3.7500	1,160	1,151	114,920	2025/02/01
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	420	410	40,980	2024/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	662	66,097	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,410	1,271	126,871	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	1,210	1,108	110,592	2027/03/01
CANADA 3.5 03/01/28	国債証券	3.5000	480	482	48,142	2028/03/01
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,432	142,914	2024/04/01
CANADA 1.5 04/01/25	国債証券	1.5000	1,100	1,043	104,188	2025/04/01
CANADA 1.5 05/01/24	国債証券	1.5000	940	907	90,610	2024/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	655	65,387	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	740	842	84,063	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	610	737	73,611	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	280	332	33,171	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	970	947	94,560	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	570	621	62,003	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	850	797	79,553	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,320	1,273	127,124	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	550	498	49,729	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	430	405	40,463	2029/06/01
CANADA 1.5 06/01/30	国債証券	1.2500	1,850	1,608	160,516	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,470	2,151	214,768	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	1,940	1,741	173,827	2032/06/01
CANADA 2.75 08/01/24	国債証券	2.7500	590	576	57,579	2024/08/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	440	422	42,143	2024/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,910	1,755	175,177	2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	850	825	82,361	2027/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,270	1,161	115,930	2026/09/01
CANADA 0.75 10/01/24	国債証券	0.7500	810	766	76,518	2024/10/01
CANADA 3.0 10/01/25	国債証券	3.0000	500	489	48,838	2025/10/01
CANADA 3.0 11/01/24	国債証券	3.0000	860	842	84,120	2024/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	700	719	71,803	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	630	571	57,018	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,820	2,152	214,810	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	2,200	1,560	155,691	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	390	345	34,442	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,800	1,458	145,555	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	2,020	1,746	174,312	2031/12/01
CANADA 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,300	1,215	121,266	2032/12/01
CANADA 2.25 12/01/29	国債証券	2.2500	500	469	46,853	2029/12/01
小計	—	—	41,990	38,354	3,827,785	—
(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	880	719	66,774	2047/03/21

銘柄	当	期				末												
		種	類	利	率		額	面	金	額	評		額	償	還	年	月	日
											外	貨						
(オーストラリア)																		
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国	債	証	券	%	千	オーストラリア・ドル	千	オーストラリア・ドル	千	円							2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国	債	証	券	3.2500		1,380		1,372		127,357							2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国	債	証	券	4.7500		840		877		81,455							2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国	債	証	券	2.7500		970		959		89,073							2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国	債	証	券	4.2500		1,200		1,225		113,742							2026/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国	債	証	券	3.2500		1,500		1,466		136,143							2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国	債	証	券	4.5000		1,230		1,301		120,771							2033/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国	債	証	券	3.7500		830		804		74,696							2037/04/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国	債	証	券	2.2500		880		822		76,347							2028/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国	債	証	券	2.5000		1,810		1,671		155,113							2030/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国	債	証	券	2.7500		900		736		68,400							2041/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国	債	証	券	1.2500		1,890		1,517		140,866							2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国	債	証	券	3.7500		1,200		1,187		110,260							2034/05/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国	債	証	券	3.2500		820		735		68,266							2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国	債	証	券	1.5000		1,610		1,350		125,353							2031/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国	債	証	券	2.7500		650		574		53,337							2035/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国	債	証	券	1.7500		1,200		716		66,507							2051/06/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国	債	証	券	0.5000		1,815		1,629		151,265							2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国	債	証	券	2.7500		960		916		85,049							2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国	債	証	券	2.7500		1,230		1,183		109,875							2027/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国	債	証	券	2.7500		1,400		1,320		122,592							2029/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国	債	証	券	3.0000		1,170		1,084		100,627							2033/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国	債	証	券	1.7500		1,850		1,542		143,147							2032/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国	債	証	券	1.0000		2,170		1,722		159,897							2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国	債	証	券	0.2500		1,360		1,244		115,518							2025/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国	債	証	券	0.2500		1,990		1,878		174,356							2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国	債	証	券	1.0000		1,670		1,360		126,286							2030/12/21
小計	-	-	-	-	-		35,405		31,922		2,963,084							-
(シンガポール)																		
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国	債	証	券	%	千	シンガポール・ドル	千	シンガポール・ドル	千	円							2024/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国	債	証	券	2.0000		280		276		27,762							2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国	債	証	券	3.5000		800		810		81,493							2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国	債	証	券	2.7500		500		482		48,469							2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国	債	証	券	1.8750		490		402		40,454							2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国	債	証	券	2.7500		340		325		32,749							2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国	債	証	券	2.6250		420		410		41,263							2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国	債	証	券	2.3750		780		764		76,828							2025/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国	債	証	券	2.1250		370		357		35,923							2026/06/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国	債	証	券	2.8750		590		580		58,381							2029/07/01
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国	債	証	券	2.3750		190		169		17,081							2039/07/01
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国	債	証	券	1.6250		350		310		31,180							2031/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国	債	証	券	3.0000		125		133		13,468							2072/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国	債	証	券	2.2500		590		528		53,119							2036/08/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国	債	証	券	3.0000		720		717		72,120							2024/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国	債	証	券	2.8750		620		606		61,025							2030/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国	債	証	券	3.3750		330		335		33,709							2033/09/01
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国	債	証	券	2.8750		200		198		19,950							2027/09/01
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国	債	証	券	1.8750		410		342		34,462							2051/10/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国	債	証	券	1.2500		410		382		38,467							2026/11/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国	債	証	券	0.5000		380		353		35,499							2025/11/01
小計	-	-	-	-	-		8,895		8,486		853,411							-
(ニュージーランド)																		
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国	債	証	券	%	千	ニュージーランド・ドル	千	ニュージーランド・ドル	千	円							2027/04/15
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国	債	証	券	4.5000		700		704		59,147							2027/04/15

銘柄	柄	当期				期末	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33		国債証券	3.5000	350	326	27,388	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37		国債証券	2.7500	330	269	22,671	2037/04/15
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25		国債証券	2.7500	570	548	46,062	2025/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29		国債証券	3.0000	350	325	27,343	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51		国債証券	2.7500	440	320	26,955	2051/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41		国債証券	1.7500	400	261	21,933	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31		国債証券	1.5000	580	467	39,248	2031/05/15
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34		国債証券	4.2500	130	128	10,762	2034/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32		国債証券	2.0000	350	288	24,274	2032/05/15
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28		国債証券	0.2500	350	284	23,880	2028/05/15
NEW ZEALAND 0.5 05/15/24		国債証券	0.5000	650	616	51,759	2024/05/15
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26		国債証券	0.5000	360	318	26,719	2026/05/15
小計		—	—	5,560	4,858	408,149	—
(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	1,140	1,024	165,561	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45		国債証券	3.5000	1,450	1,349	218,056	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60		国債証券	4.0000	900	935	151,164	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49		国債証券	1.7500	630	407	65,817	2049/01/22
UK TREASURY 3.75 01/29/38		国債証券	3.7500	400	393	63,654	2038/01/29
UK TREASURY 0.875 01/31/46		国債証券	0.8750	1,670	895	144,822	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39		国債証券	1.1250	760	511	82,633	2039/01/31
UK TREASURY 1.0 01/31/32		国債証券	1.0000	2,370	1,911	308,921	2032/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24		国債証券	0.1250	1,800	1,739	281,174	2024/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29		国債証券	0.5000	680	571	92,378	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28		国債証券	0.1250	1,040	886	143,227	2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25		国債証券	0.2500	2,400	2,245	362,991	2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26		国債証券	0.1250	1,150	1,048	169,427	2026/01/30
UK TREASURY 4.125 01/29/27		国債証券	4.1250	800	815	131,800	2027/01/29
UK TREASURY 5.0 03/07/25		国債証券	5.0000	1,095	1,127	182,246	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36		国債証券	4.2500	1,700	1,782	288,153	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24		国債証券	1.0000	950	920	148,822	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32		国債証券	4.2500	1,440	1,527	246,876	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25		国債証券	0.6250	1,060	996	161,098	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47		国債証券	1.5000	1,000	616	99,579	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51		国債証券	1.2500	1,630	889	143,790	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52		国債証券	3.7500	970	940	152,076	2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53		国債証券	1.5000	1,110	638	103,220	2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57		国債証券	1.7500	1,130	685	110,865	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65		国債証券	2.5000	1,250	922	149,098	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68		国債証券	3.5000	930	882	142,612	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26		国債証券	1.5000	1,100	1,033	167,081	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27		国債証券	1.2500	1,600	1,461	236,203	2027/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33		国債証券	0.8750	900	686	111,006	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31		国債証券	0.2500	1,770	1,352	218,668	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35		国債証券	0.6250	1,350	936	151,303	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39		国債証券	4.2500	1,260	1,311	211,965	2039/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24		国債証券	2.7500	810	798	129,072	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25		国債証券	2.0000	1,190	1,150	185,901	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34		国債証券	4.5000	900	971	157,087	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37		国債証券	1.7500	1,390	1,066	172,392	2037/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54		国債証券	1.6250	870	515	83,279	2054/10/22

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	1,460	511	82,741	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	830	451	72,904	2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73	国債証券	1.1250	740	317	51,393	2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	1,600	1,036	167,567	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	450	202	32,747	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	1,130	1,028	166,269	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	2,260	1,922	310,711	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	1,220	969	156,774	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	1,390	1,244	201,133	2026/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	680	770	124,599	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	980	1,080	174,681	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,265	1,362	220,223	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,080	1,122	181,458	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,212	1,294	209,168	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	910	944	152,599	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,070	1,113	179,988	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,395	1,521	245,866	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	1,017	1,065	172,151	2049/12/07
小計	—	—	65,284	55,908	9,037,014	—
(イスラエル)		%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	1,090	1,342	50,386	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国債証券	0.5000	310	280	10,514	2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	2,090	2,078	78,013	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	2,230	2,076	77,940	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	1,320	1,311	49,247	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	2,860	2,380	89,364	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	1,890	1,749	65,680	2025/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	1,450	1,096	41,155	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,300	2,176	81,698	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	1,460	1,347	50,569	2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	220	237	8,917	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	国債証券	0.4000	320	300	11,286	2024/10/31
小計	—	—	17,540	16,376	614,774	—
(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	3,760	2,037	39,256	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	7,860	9,812	189,081	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	4,040	3,926	75,669	2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	6,350	5,749	110,795	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	4,830	4,202	80,975	2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	4,180	3,337	64,317	2031/11/15
DENMARK 0.0 11/15/24	国債証券	0.0000	2,200	2,090	40,284	2024/11/15
小計	—	—	33,220	31,156	600,381	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	4,480	4,252	55,831	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	2,400	2,266	29,760	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	2,370	2,358	30,962	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	6,130	5,931	77,883	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	1,950	25,605	2028/04/26
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	1,980	1,805	23,710	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	4,310	3,788	49,745	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	2,620	2,396	31,459	2029/09/06

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				期		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(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 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,650	2,260	29,686	2031/09/17
小計	—	—	29,010	27,010	354,646	—
(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	3,420	3,860	50,146	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	2,890	2,632	34,192	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	6,120	6,057	78,681	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	5,420	4,469	58,060	2031/05/12
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	2,654	34,482	2032/06/01
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	6,210	5,833	75,777	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,010	2,685	34,885	2029/11/12
小計	—	—	29,770	28,193	366,227	—
(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	29,842	26,541	194,062	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	10,580	9,121	66,691	2027/03/04
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	9,180	8,225	60,143	2025/03/06
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	20,159	19,594	143,272	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,648	28,407	207,710	2031/05/29
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	5,790	5,244	38,343	2033/05/26
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	24,746	23,052	168,555	2027/06/03
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	6,290	5,645	41,276	2053/07/31
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	22,070	21,098	154,263	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	17,277	15,096	110,380	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	16,161	14,508	106,083	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,807	108,271	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,931	43,367	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	4,835	4,411	32,257	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	15,902	15,707	114,846	2024/12/05
小計	—	—	234,607	217,394	1,589,526	—
(中国)		%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	20,000	19,779	387,117	2032/02/17
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	34,500	34,380	672,902	2025/02/24
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	5,100	5,167	101,145	2050/03/16
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	10,997	215,235	2029/03/24
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	国債証券	2.2800	12,000	12,005	234,970	2024/03/17
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	14,320	14,442	282,676	2052/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	2,100	2,255	44,148	2051/04/12
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	30,100	29,875	584,732	2027/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	1,000	1,013	19,830	2031/05/27
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	3,000	2,969	58,114	2032/05/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,600	6,522	127,660	2030/05/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,452	165,436	2025/05/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	7,500	7,549	147,767	2027/06/04
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	20,000	19,904	389,565	2029/06/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	450	460	9,015	2026/06/06
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	国債証券	2.1800	4,200	4,193	82,076	2024/06/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,256	396,471	2027/07/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	13,000	12,764	249,819	2032/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	30,000	29,770	582,671	2025/08/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	26,600	26,675	522,102	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	国債証券	3.5900	5,000	5,236	102,489	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	国債証券	2.6000	7,300	7,120	139,358	2032/09/01

銘	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	15,300	15,328	300,017	2024/09/02	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	国債証券	2.6200	17,500	17,269	338,002	2029/09/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	国債証券	1.9900	10,000	9,952	194,784	2024/09/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	18,950	19,723	386,034	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	15,600	15,727	307,828	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	国債証券	2.4400	11,000	10,892	213,183	2027/10/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	国債証券	2.8000	17,300	17,178	336,224	2032/11/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	4,100	4,107	80,384	2031/11/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	国債証券	2.2800	14,800	14,705	287,825	2025/11/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	国債証券	2.7900	9,000	8,959	175,359	2029/12/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	3,500	3,608	70,632	2027/12/03	
小計	—	—	419,720	419,249	8,205,585	—	
(マレーシア)			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	600	606	18,376	2027/03/15	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	300	316	9,589	2046/03/15	
MALAYSIA 3.882 03/14/25	国債証券	3.8820	300	302	9,173	2025/03/14	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,050	1,077	32,645	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,200	1,253	37,974	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,660	1,632	49,455	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,700	1,806	54,730	2037/04/07	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,000	913	27,676	2031/04/15	
MALAYSIA 4.504 04/30/29	国債証券	4.5040	300	312	9,471	2029/04/30	
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	650	646	19,599	2027/05/31	
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	1,500	1,413	42,811	2040/05/22	
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	600	608	18,440	2035/05/31	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,004	60,726	2028/06/15	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	670	683	20,720	2031/06/30	
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	620	672	20,372	2038/06/08	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,000	1,003	30,395	2024/06/14	
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	400	377	11,430	2050/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	1,030	1,041	31,556	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	1,990	2,145	65,000	2048/07/06	
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	920	931	28,222	2026/07/15	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,820	1,778	53,865	2034/07/05	
MALAYSIA 3.582 07/15/32	国債証券	3.5820	1,400	1,366	41,392	2032/07/15	
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	700	702	21,286	2029/08/15	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	2,400	2,429	73,614	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,600	1,725	52,286	2043/09/30	
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	900	909	27,561	2024/09/30	
MALAYSIA 4.696 10/15/42	国債証券	4.6960	1,200	1,272	38,537	2042/10/15	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,660	1,683	51,001	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	1,430	1,447	43,851	2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	950	1,006	30,484	2033/11/07	
小計	—	—	33,550	34,072	1,032,254	—	
(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 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,391	42,100	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,480	2,923	88,426	2028/04/25	
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	2,370	1,609	48,679	2032/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	780	748	22,634	2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	3,370	2,995	90,600	2025/04/25	
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	1,450	1,303	39,438	2027/05/25	

銘	柄	当期					末
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(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 07/25/26	国債証券	2.5000	2,790	2,456	74,295	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	3,830	3,562	107,763	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,360	2,007	60,709	2027/07/25	
POLAND 07/25/24	国債証券	0.0000	1,710	1,571	47,534	2024/07/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	630	504	15,259	2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	2,150	2,015	60,979	2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	3,930	2,716	82,172	2030/10/25	
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,880	1,504	45,504	2026/10/25	
小計	—	—	32,170	27,310	826,099	—	
(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	840	678	97,320	2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	360	321	46,147	2031/03/18	
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	240	241	34,614	2024/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	850	893	128,106	2025/03/13	
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	250	159	22,810	2041/04/22	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	580	402	57,806	2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	390	331	47,564	2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	590	574	82,454	2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	610	555	79,654	2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	730	659	94,564	2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	950	899	129,077	2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	350	292	41,922	2037/05/15	
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	370	270	38,782	2035/05/15	
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	520	467	67,011	2027/05/15	
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	870	679	97,428	2031/10/18	
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	400	314	45,125	2032/10/18	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	550	451	64,775	2030/10/18	
小計	—	—	9,450	8,192	1,175,166	—	
(ユーロ…オランダ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,320	1,510	216,714	2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,540	1,567	224,837	2047/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,000	488	70,076	2052/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	780	881	126,470	2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,280	1,454	208,697	2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,110	1,087	156,000	2033/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	550	364	52,258	2038/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,110	775	111,308	2040/01/15	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	360	313	44,992	2054/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	1,110	948	136,123	2029/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,080	972	139,514	2027/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	640	590	84,697	2026/01/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,420	1,317	189,022	2026/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,140	1,124	161,327	2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,490	1,402	201,127	2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,240	1,121	160,908	2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,160	1,068	153,227	2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,060	911	130,746	2029/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	700	575	82,581	2030/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,200	960	137,748	2031/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	200	163	23,462	2032/07/15	
小計	—	—	21,490	19,601	2,811,844	—	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	1,570	1,769	253,826	2028/03/28	
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,280	1,440	206,696	2041/03/28	
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,070	1,122	161,070	2026/03/28	
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	630	678	97,342	2032/03/28	
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,220	1,440	206,598	2035/03/28	
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	810	684	98,207	2033/04/22	
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500	220	205	29,452	2039/04/22	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	740	787	112,920	2045/06/22	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	780	556	79,875	2047/06/22	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	980	697	100,014	2050/06/22	
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	710	453	65,042	2053/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	390	307	44,168	2057/06/22	
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	450	342	49,111	2066/06/22	
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	670	275	39,451	2071/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,030	971	139,373	2026/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	840	834	119,770	2024/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,570	1,348	193,449	2031/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	1,010	909	130,468	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	450	278	40,016	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,430	1,272	182,594	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	680	670	96,134	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	610	510	73,245	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,980	1,888	270,861	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	960	881	126,503	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	380	302	43,460	2037/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	1,300	1,066	153,048	2030/06/22	
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500	600	471	67,607	2032/06/22	
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	750	720	103,373	2024/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	940	728	104,517	2031/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	580	509	73,051	2027/10/22	
小計	—	—	26,630	24,128	3,461,253	—	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	2,450	2,192	314,456	2027/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	2,910	2,672	383,300	2026/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	1,220	1,183	169,796	2024/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	国債証券	0.0000	1,990	1,876	269,117	2025/02/25	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500	1,980	1,789	256,749	2028/02/25	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	3,020	2,923	419,317	2024/03/25	
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	3,320	3,122	447,954	2025/03/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	3,000	3,058	438,763	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,640	3,099	444,621	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,530	1,756	252,027	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,170	1,372	196,903	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	3,880	4,463	640,344	2029/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,930	2,252	323,055	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	2,470	2,486	356,634	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,950	1,548	222,122	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	2,470	1,719	246,634	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	2,040	1,112	159,652	2052/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	1,950	1,038	148,975	2053/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	990	678	97,377	2066/05/25	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	790	303	43,504	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	2,500	2,475	355,131	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	4,550	4,467	640,891	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,110	4,602	660,267	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,480	3,152	452,258	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	4,230	4,008	574,961	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	3,590	3,123	448,037	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,860	2,380	341,450	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	3,460	3,210	460,508	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	2,360	2,191	314,327	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,650	1,065	152,893	2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	3,190	2,551	365,992	2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	500	384	55,135	2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国債証券	2.5000	250	222	31,949	2043/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	2,290	1,757	252,091	2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	2,070	1,706	244,852	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,150	680	97,578	2044/06/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,170	2,340	335,802	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	3,890	3,882	556,952	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,940	2,134	306,132	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,510	3,108	445,887	2032/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,380	2,330	334,287	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,740	2,606	373,927	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,620	2,382	341,795	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	3,400	3,033	435,169	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	3,270	2,556	366,670	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	3,780	3,048	437,298	2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国債証券	2.0000	1,600	1,476	211,757	2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,890	2,399	344,241	2029/11/25
小計	—	—	120,130	109,930	15,769,556	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,310	1,493	214,254	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	780	965	138,430	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,520	1,847	265,041	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,830	2,144	307,667	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,900	1,815	260,429	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	2,660	2,496	358,117	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	2,080	1,828	262,241	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,940	1,761	252,687	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,430	1,413	202,749	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,120	1,937	277,926	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	1,840	1,521	218,263	2031/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	2,900	2,340	335,782	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	2,620	2,215	317,775	2030/02/15
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	国債証券	0.0000	1,500	1,455	208,741	2024/03/15
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,260	1,220	175,013	2024/04/05
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,590	1,498	214,963	2025/04/11
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	2,110	1,943	278,846	2026/04/10
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	1,360	1,224	175,662	2027/04/16
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,520	1,493	214,299	2024/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,660	1,223	175,440	2035/05/15

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
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000		350	282	40,482	2038/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000		1,580	1,133	162,637	2036/05/15	
BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	国債証券	0.2000		1,250	1,206	173,032	2024/06/14	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000		850	985	141,339	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500		560	622	89,277	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500		1,700	2,093	300,283	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500		1,330	1,480	212,336	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000		2,070	2,084	298,951	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500		1,410	1,847	265,047	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500		1,820	2,227	319,477	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000		2,170	2,205	316,314	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000		1,040	525	75,360	2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000		500	434	62,328	2053/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500		2,430	1,914	274,671	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000		2,420	2,317	332,464	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000		1,910	1,749	250,924	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000		1,980	1,810	259,750	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500		1,770	1,570	225,347	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000		1,820	1,770	253,925	2024/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000		1,990	1,702	244,286	2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000		2,230	1,182	169,652	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000		1,430	1,342	192,628	2032/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000		2,190	1,789	256,743	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000		710	376	54,038	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000		2,430	2,032	291,544	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000		590	494	70,887	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000		800	654	93,934	2031/08/15	
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	国債証券	0.4000		900	865	124,202	2024/09/13	
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000		1,590	1,516	217,554	2024/10/18	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000		1,360	1,238	177,641	2026/10/09	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000		1,750	1,630	233,851	2025/10/10	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000		1,880	1,780	255,344	2027/10/15	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000		450	419	60,243	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000		1,620	1,440	206,670	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000		2,060	1,792	257,198	2028/11/15	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000		800	781	112,076	2029/11/15	
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	国債証券	2.2000		1,350	1,333	191,285	2024/12/12	
小計	—	—		91,020	84,475	12,118,072	—	
(ユーロ…スペイン)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000		1,460	1,682	241,329	2029/01/31	
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000		1,200	1,219	174,885	2024/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000		1,400	1,480	212,407	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000		2,050	1,932	277,228	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000		1,610	1,426	204,579	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000		1,160	996	142,881	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000		1,960	1,789	256,768	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000		1,630	1,580	226,690	2025/04/30	
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000		1,470	1,483	212,736	2024/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000		2,210	2,073	297,511	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500		1,330	1,284	184,311	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000		1,170	1,073	153,970	2028/04/30	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,400	1,266	181,616	2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,550	1,226	176,010	2032/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,500	1,242	178,240	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,380	1,066	153,023	2031/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	1,110	1,068	153,206	2024/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	670	624	89,589	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,630	1,778	255,064	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,290	1,477	211,882	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,630	1,834	263,149	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,120	1,020	146,328	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,135	1,176	168,776	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,770	1,620	232,436	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,815	2,167	310,970	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,470	1,325	190,206	2033/07/30
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	250	236	33,860	2043/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,510	1,380	198,013	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,840	1,521	218,249	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	1,080	1,037	148,864	2024/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	600	408	58,668	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	540	336	48,220	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,750	1,580	226,787	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	700	603	86,557	2029/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	2,190	2,180	312,749	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,830	2,014	288,987	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,210	1,458	209,176	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,180	1,026	147,252	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,190	983	141,024	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	670	439	63,062	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	410	196	28,229	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,590	846	121,393	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	2,010	1,964	281,833	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,560	1,448	207,740	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,730	1,625	233,239	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,530	1,295	185,780	2029/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,640	1,294	185,709	2031/10/31
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,720	1,597	229,206	2032/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,260	845	121,305	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,750	1,514	217,197	2030/10/31
小計	—	—	69,860	64,753	9,288,912	—
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,310	1,181	169,475	2027/01/15
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	300	300	43,125	2026/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,460	1,635	234,590	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	2,170	2,094	300,422	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,350	1,249	179,236	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,800	1,697	243,575	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,610	1,475	211,666	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	1,500	1,231	176,723	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,090	825	118,364	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,190	1,025	147,101	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,710	1,729	248,084	2024/03/01

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	期		末						
									評			額	償				
									外	貨				建	金	額	額
(ユーロ…イタリア)					%		千	ユー	口	千	ユー	口	千	円			
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国	債	証	券	2.8000	700			485		69,607				2067/03/01		
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国	債	証	券	2.1500	360			209		30,091				2072/03/01		
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国	債	証	券	5.0000	560			577		82,809				2025/03/01		
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国	債	証	券	4.5000	1,910			1,963		281,716				2026/03/01		
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国	債	証	券	1.6500	1,790			1,466		210,341				2032/03/01		
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国	債	証	券	3.1000	2,350			1,981		284,218				2040/03/01		
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国	債	証	券	3.3500	1,020			922		132,392				2035/03/01		
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国	債	証	券	3.5000	1,870			1,828		262,352				2030/03/01		
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国	債	証	券	1.4500	1,120			805		115,517				2036/03/01		
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国	債	証	券	1.8000	1,150			785		112,672				2041/03/01		
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国	債	証	券	0.9500	1,080			705		101,182				2037/03/01		
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国	債	証	券	3.2500	600			522		74,992				2038/03/01		
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国	債	証	券	0.2500	1,460			1,229		176,429				2028/03/15		
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国	債	証	券	4.0000	660			637		91,495				2035/04/30		
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国	債	証	券	1.5000	810			486		69,716				2045/04/30		
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国	債	証	券	1.3500	1,550			1,306		187,389				2030/04/01		
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国	債	証	券	0.9000	1,610			1,268		181,937				2031/04/01		
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国	債	証	券	0.0000	1,400			1,348		193,479				2024/04/15		
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国	債	証	券	3.4000	550			540		77,564				2028/04/01		
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国	債	証	券	0.0000	1,520			1,363		195,585				2026/04/01		
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国	債	証	券	1.1000	1,100			996		142,922				2027/04/01		
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国	債	証	券	6.0000	2,480			2,836		406,842				2031/05/01		
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国	債	証	券	1.8500	990			972		139,517				2024/05/15		
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国	債	証	券	1.4500	1,280			1,228		176,239				2025/05/15		
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国	債	証	券	4.4000	200			201		28,948				2033/05/01		
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国	債	証	券	1.6000	1,350			1,271		182,328				2026/06/01		
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国	債	証	券	1.5000	1,460			1,400		200,836				2025/06/01		
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国	債	証	券	2.2000	1,290			1,219		175,002				2027/06/01		
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国	債	証	券	0.9500	1,380			1,048		150,371				2032/06/01		
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国	債	証	券	2.8000	1,200			1,129		162,052				2029/06/15		
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国	債	証	券	2.1000	1,290			1,231		176,614				2026/07/15		
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国	債	証	券	1.7500	1,200			1,174		168,428				2024/07/01		
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国	債	証	券	0.5000	1,100			927		133,115				2028/07/15		
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国	債	証	券	1.8500	1,240			1,196		171,670				2025/07/01		
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国	債	証	券	5.0000	1,660			1,757		252,057				2034/08/01		
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国	債	証	券	5.0000	1,170			1,246		178,813				2039/08/01		
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国	債	証	券	2.0500	1,500			1,404		201,465				2027/08/01		
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国	債	証	券	3.0000	1,610			1,535		220,254				2029/08/01		
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国	債	証	券	0.6000	1,520			1,150		165,069				2031/08/01		
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国	債	証	券	0.9500	1,350			1,090		156,378				2030/08/01		
ITALY BTPS 4.0 08/15/24	国	債	証	券	0.0000	1,460			1,389		199,277				2024/08/15		
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国	債	証	券	1.2000	1,360			1,287		184,674				2025/08/15		
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国	債	証	券	0.0000	1,250			1,108		159,050				2026/08/01		
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国	債	証	券	2.9500	1,810			1,525		218,828				2038/09/01		
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国	債	証	券	4.7500	1,110			1,156		165,911				2044/09/01		
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国	債	証	券	3.2500	1,180			986		141,559				2046/09/01		
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国	債	証	券	4.7500	1,680			1,765		253,286				2028/09/01		
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国	債	証	券	5.0000	1,250			1,337		191,918				2040/09/01		
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国	債	証	券	2.4500	1,150			806		115,658				2050/09/01		
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国	債	証	券	1.7000	1,020			595		85,400				2051/09/01		
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国	債	証	券	2.4500	1,330			1,126		161,584				2033/09/01		

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	
(ユーロ…イタリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	510	326	46,792	2052/09/01	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,620	1,628	233,638	2024/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	850	776	111,363	2049/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	860	680	97,558	2036/09/01	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,680	1,493	214,269	2027/09/15	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	350	395	56,749	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,510	1,698	243,685	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	2,140	2,329	334,212	2029/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	680	658	94,459	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	1,350	1,317	188,940	2025/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	1,660	1,596	228,985	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,530	1,406	201,823	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	1,637	1,613	231,494	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,740	1,656	237,564	2028/12/01	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	1,700	1,312	188,276	2031/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,740	1,470	210,955	2030/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,340	1,161	166,670	2032/12/01	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国債証券	3.8500	800	795	114,082	2029/12/15	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	国債証券	0.0000	1,360	1,279	183,569	2024/12/15	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国債証券	2.6500	1,220	1,165	167,238	2027/12/01	
小 計	—	—	106,807	97,750	14,022,270	—	
(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	320	148	21,335	2052/04/15	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	370	366	52,545	2024/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	200	168	24,206	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	390	286	41,101	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	460	429	61,648	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	480	392	56,370	2034/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券	0.5000	380	235	33,842	2043/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	290	197	28,384	2036/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/27	国債証券	1.3750	110	103	14,905	2027/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	410	422	60,548	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	490	488	70,016	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	430	404	57,984	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	300	257	36,986	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	350	333	47,855	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	550	483	69,295	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	420	379	54,371	2027/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	290	178	25,651	2040/09/15	
FINLAND 1.5 09/15/32	国債証券	1.5000	50	43	6,298	2032/09/15	
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	300	236	33,990	2031/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	210	168	24,221	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	410	392	56,286	2024/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/26	国債証券	0.0000	430	388	55,752	2026/09/15	
小 計	—	—	7,640	6,508	933,600	—	
(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	240	279	40,061	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	640	471	67,598	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	920	799	114,719	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	835	754	108,210	2028/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	710	561	80,597	2031/02/20	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ・オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000	900	751	107,806	2032/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	930	759	108,894	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	710	753	108,052	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	990	1,106	158,759	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	590	340	48,873	2051/03/20
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	210	94	13,571	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	1,070	974	139,748	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	580	544	78,164	2025/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	770	720	103,422	2034/05/23
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	290	228	32,749	2049/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	310	127	18,336	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	540	545	78,195	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	415	472	67,713	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	520	499	71,615	2024/07/15
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	160	155	22,342	2026/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	285	40,901	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	930	910	130,642	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,190	1,104	158,454	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	940	902	129,412	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	380	259	37,176	2036/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	450	258	37,104	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	570	484	69,568	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	190	113	16,225	2086/11/02
小 計	—	—	17,370	15,259	2,188,922	—
合 計	—	—	—	—	185,001,333	—

■投資信託財産の構成

2023年2月21日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 185,001,333	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,186,068	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	188,187,402	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、186,640,391千円、99.2%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、2023年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=134.32円、1カナダ・ドル=99.80円、1オーストラリア・ドル=92.82円、1シンガポール・ドル=100.56円、1ニュージーランド・ドル=84.00円、1イギリス・ポンド=161.64円、1イスラエル・シェケル=37.54円、1デンマーク・クローネ=19.27円、1ノルウェー・クローネ=13.13円、1スウェーデン・クローナ=12.99円、1メキシコ・ペソ=7.311円、1オフショア・人民元=19.572円、1マレーシア・リンギット=30.295円、1ポーランド・ズロチ=30.248円、1ユーロ=143.45円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	188,187,402,199円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,927,378,048
公 社	185,001,333,837
未 収 利 息	1,090,149,276
前 払 費 用	168,541,038
(B) 負 債	1,365,031,536
未 払 金	1,352,244,536
未 払 解 約 金	12,787,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	186,822,370,663
元 次 本 金	92,568,430,085
期 繰 越 損 益	94,253,940,578
(D) 受 益 権 総 口 数	92,568,430,085口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	20,182円

(注1) 期首元本額	70,448,298,510円
追加設定元本額	63,457,547,851円
一部解約元本額	41,337,416,276円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	8,063,618,127円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	4,664,534円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	25,013,145円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	61,798,332円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	61,093,331円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,637,226円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	48,023,427円
たわらノーロード 先進国債券	17,008,425,615円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	245,317,778円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,489,017,308円
たわらノーロード バランス (堅実型)	65,360,184円
たわらノーロード バランス (標準型)	335,170,560円
たわらノーロード バランス (積極型)	71,793,070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)	16,208,215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)	982,389,497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)	1,586,938,015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)	725,563,344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)	429,869,427円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	2,046,942円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	13,848,744円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	179,191,650円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	14,908,588円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	24,576,579円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,613,575,783円
One DC 先進国債券インデックスファンド	837,273,305円
Oneグローバルバランス	18,428,191円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	743,440,279円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,368,236,637円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,625,122,028円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	419,973,327円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	846,255,978円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	741,934,563円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	14,015,594円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	512,673,651円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	36,330,259円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	146,595,885円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	150,866,647円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	231,293,861円
グループコントロール	895,480,870円
D I A M 8資産/バランスファンドN<DC年金>	180,603,325円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	600,448,211円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	610,839,468円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,820,147円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	318,874,880円

D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,051,013,220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)	259,574,682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)	265,741,005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)	128,786,227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)	162,358,218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)	256,453,982円
インカム重視マルチアセット運用ファンドI I 2021-04 (適格機関投資家限定)	618,270,983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・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	198,620,020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)	231,445,712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・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	208,546,866円
D I A M海替フルレンジ外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	5,554,465,372円
D I A M外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,585,064,790円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,555,775,823円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,282,640,293円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	81,242,436円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	49,166,703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)	442,107,851円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	362,944,405円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	238,451,787円
D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,931,845円
D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	29,911,489円
D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,822,125円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	49,876円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	14,713,798円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	43,966,666円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,620,938,828円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,399,685,001円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,546,932,927円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	65,747,358円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	124,222,256円
D I A Mアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,489,912,024円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	300,752,649円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	163,842円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	305,817,896円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	273,773,162円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	379,947,236円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	46,662,175円
動的パッケージファンド<DC年金>	56,505,520円
コア資産形成ファンド	37,769,335円
M H A M外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	756,300,586円
M H A M外国債券インデックスファンド<海替ヘッジあり> (ファンドラップ)	514,130,947円
M H A M動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	7,052,612,220円
M H A M外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	3,364,933,377円
期末元本合計	92,568,430,085円

■損益の状況

当期 自2022年2月22日 至2023年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,630,658,528	円
	受取利息	3,630,482,398	
	その他の収益	573,045	
	支払利息	△396,915	
(B)	有価証券売買損益	△4,048,984,550	
	売却益	22,763,661,538	
	売却損	△26,812,646,088	
(C)	その他の費用	△27,916,414	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△446,242,436	
(E)	前期繰越損益金	71,516,620,489	
(F)	解約差損益金	△44,647,207,624	
(G)	追加信託差損益金	67,830,770,149	
(H)	計(D+E+F+G)	94,253,940,578	
	次期繰越損益金(H)	94,253,940,578	

(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。