

運用報告書 (全体版)

第12期<決算日2020年10月12日>

DIAM外国債券パッシブ・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 商品分類 | 追加型投信/海外/債券 (インデックス型) |
| 信託期間 | 2009年1月30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、円ベース、為替ヘッジなし) の動き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 | DIAM外国債券パッシブ・ファンド 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 | 原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。実質組入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。マザーファンドにおいては、外国債券への投資は原則として高位を維持します。 |
| 組入制限 | マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | 決算日 (原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の利子配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。 |

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM外国債券パッシブ・ファンド」は、2020年10月12日に第12期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

DIAM外国債券パッシブ・ファンド

■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 比率 | 債券先物 比率 | 純資産 総額 |
|-------------------|-------------|---------------|---------------|---|---------------|------------|------------|--------------|
| | (分配落) | 税込 分配 金 | 期中 騰落 率 | 期中 騰落 率 | 期中 騰落 率 | | | |
| 8期 (2016年10月12日) | 円 14,404 | 円 0 | % △12.6 | ポイント 103,992.55 | % △12.2 | % 97.3 | % - | 百万円 8,188 |
| 9期 (2017年10月12日) | 15,910 | 0 | 10.5 | 115,318.15 | 10.9 | 96.8 | - | 12,486 |
| 10期 (2018年10月12日) | 15,406 | 0 | △3.2 | 112,209.80 | △2.7 | 97.4 | - | 14,065 |
| 11期 (2019年10月15日) | 16,056 | 0 | 4.2 | 117,767.24 | 5.0 | 97.8 | - | 16,436 |
| 12期 (2020年10月12日) | 16,904 | 0 | 5.3 | 124,690.29 | 5.9 | 98.8 | - | 14,201 |

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

(注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 | | F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 債券組入 比 | 債券先物 比 |
|---------------------------|---------|--------|---|--------|-----------|-----------|
| | 円 | 騰 落 率 | ポイ ント | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2019 年 10 月 15 日 | 16,056 | % - | ポイ ント 117,767.24 | % - | % 97.8 | % - |
| 10 月 末 | 16,158 | 0.6 | 118,313.83 | 0.5 | 97.6 | - |
| 11 月 末 | 16,160 | 0.6 | 118,546.99 | 0.7 | 97.4 | - |
| 12 月 末 | 16,226 | 1.1 | 118,980.17 | 1.0 | 96.6 | - |
| 2020 年 1 月 末 | 16,351 | 1.8 | 120,069.31 | 2.0 | 96.7 | - |
| 2 月 末 | 16,537 | 3.0 | 121,401.29 | 3.1 | 97.3 | - |
| 3 月 末 | 16,548 | 3.1 | 121,796.59 | 3.4 | 97.4 | - |
| 4 月 末 | 16,227 | 1.1 | 119,329.72 | 1.3 | 96.1 | - |
| 5 月 末 | 16,452 | 2.5 | 120,973.12 | 2.7 | 97.2 | - |
| 6 月 末 | 16,707 | 4.1 | 123,063.01 | 4.5 | 98.4 | - |
| 7 月 末 | 16,866 | 5.0 | 123,870.50 | 5.2 | 99.0 | - |
| 8 月 末 | 16,840 | 4.9 | 124,064.52 | 5.3 | 99.3 | - |
| 9 月 末 | 16,912 | 5.3 | 124,690.18 | 5.9 | 97.8 | - |
| (期 末) 2020 年 10 月 12 日 | 16,904 | 5.3 | 124,690.29 | 5.9 | 98.8 | - |

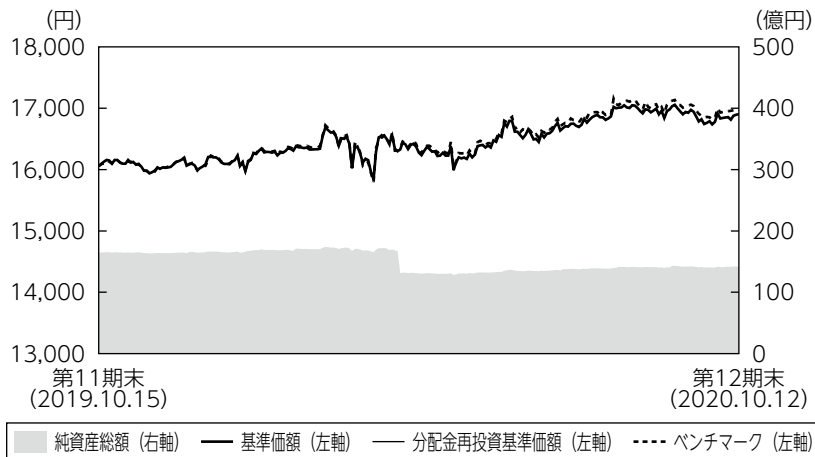
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2019年10月16日から2020年10月12日まで）

基準価額等の推移



第12期首： 16,056円
第12期末： 16,904円
(既払分配金0円)
騰落率： 5.3%
(分配金再投資ベース)

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

新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念により、F R B（米連邦準備理事会）が緊急利下げを行ったことや2023年末までゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことから米国債の利回りが大幅に低下（価格は上昇）しました。為替ではユーロ円が円安ユーロ高となったことが基準価額の上昇要因となりました。

投資環境

外国債券市場では、米国債やドイツ国債の利回りは低下する展開となりました。新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念により、各中央銀行による大幅な金融緩和政策への期待感から債券が買われる展開となりました。

為替市場ではドル円は円高ドル安に、ユーロ円は円安ユーロ高となりました。新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念により、F R Bは緊急利下げを行いました。金利の大幅な低下によりドル円は円高ドル安になりました。ユーロ円は復興基金の創設やユーロ圏の経済指標の改善から円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

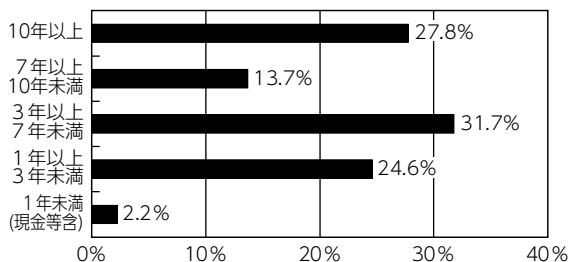
●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

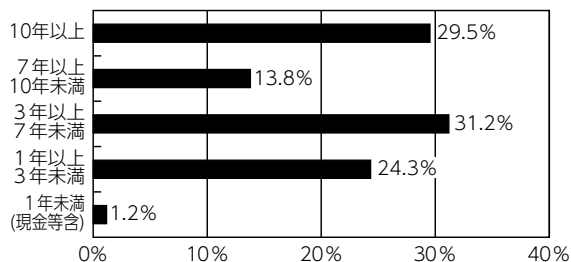
【運用状況】 ※比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)



期末



○国別構成比

期首 (前期末)

| | ファンド | 世界国債 インデックス | 差 |
|---------------|---------|----------------|--------|
| 北米 | 米国 | 47.3% | △0.8% |
| | カナダ | 1.8% | △0.1% |
| | 計 | 49.1% | △0.9% |
| 中南米 | メキシコ | 0.8% | △0.1% |
| | 計 | 0.8% | △0.1% |
| 欧州 | オーストリア | 1.4% | △0.0% |
| | ベルギー | 2.4% | △0.0% |
| | フィンランド | 0.6% | 0.0% |
| | フランス | 9.6% | △0.4% |
| | ドイツ | 6.2% | △0.1% |
| | アイルランド | 0.7% | △0.1% |
| | イタリア | 9.0% | 0.0% |
| | オランダ | 1.8% | △0.1% |
| | スペイン | 5.6% | △0.0% |
| | ユーロ計 | 37.2% | △0.7% |
| | デンマーク | 0.5% | △0.1% |
| スウェーデン | 0.3% | △0.0% | |
| 英国 | 6.0% | △0.3% | |
| ポーランド | 0.5% | △0.1% | |
| ノルウェー | 0.2% | △0.0% | |
| | 計 | 44.6% | △1.2% |
| アジア・ オセアニア | オーストラリア | 1.9% | △0.1% |
| | シンガポール | 0.4% | △0.0% |
| | マレーシア | 0.5% | 0.0% |
| | 計 | 2.7% | △0.1% |
| アフリカ | 南アフリカ | 0.5% | △0.0% |
| | 計 | 0.5% | △0.0% |
| | 現金など | 2.2% | — |
| | 合計 | 100.0% | 100.0% |

期末

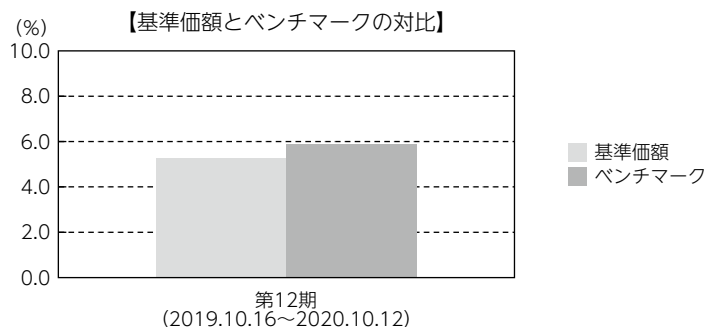
| | ファンド | 世界国債 インデックス | 差 |
|---------------|---------|----------------|--------|
| 北米 | 米国 | 43.5% | △0.8% |
| | カナダ | 1.9% | △0.0% |
| | 計 | 45.3% | △0.8% |
| 中南米 | メキシコ | 0.8% | 0.0% |
| | 計 | 0.8% | 0.0% |
| 欧州 | オーストリア | 1.5% | 1.5% |
| | ベルギー | 2.5% | 2.5% |
| | フィンランド | 0.6% | 0.6% |
| | フランス | 10.5% | 10.6% |
| | ドイツ | 7.6% | 7.7% |
| | アイルランド | 0.8% | 0.8% |
| | イタリア | 9.3% | 9.3% |
| | オランダ | 1.9% | 2.0% |
| | スペイン | 6.0% | 6.1% |
| | ユーロ計 | 40.8% | 40.9% |
| | デンマーク | 0.5% | 0.6% |
| スウェーデン | 0.3% | 0.3% | |
| 英国 | 6.4% | 6.5% | |
| ポーランド | 0.6% | 0.6% | |
| ノルウェー | 0.2% | 0.2% | |
| | 計 | 48.9% | 49.1% |
| アジア・ オセアニア | オーストラリア | 2.6% | 2.6% |
| | シンガポール | 0.4% | 0.5% |
| | マレーシア | 0.5% | 0.5% |
| | 計 | 3.5% | 3.6% |
| 中東 | イスラエル | 0.4% | 0.4% |
| | 計 | 0.4% | 0.4% |
| | 現金など | 1.2% | — |
| | 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5.9%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.6%下回りました。信託報酬等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 当期 |
|------------|-----------------------------|
| | 2019年10月16日 ～2020年10月12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 | 6,904円 |

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

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第12期 | | 項目の概要 |
|-----------|-------------------------------|---------|--|
| | (2019年10月16日 ～2020年10月12日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 81円 | 0.491% | (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16,458円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、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 |
| (投信会社) | (72) | (0.436) | |
| (販売会社) | (4) | (0.022) | |
| (受託会社) | (5) | (0.033) | |
| (b) その他費用 | 3 | 0.016 | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (保管費用) | (2) | (0.012) | |
| (監査費用) | (1) | (0.004) | |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| 合計 | 83 | 0.507 | |

(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。

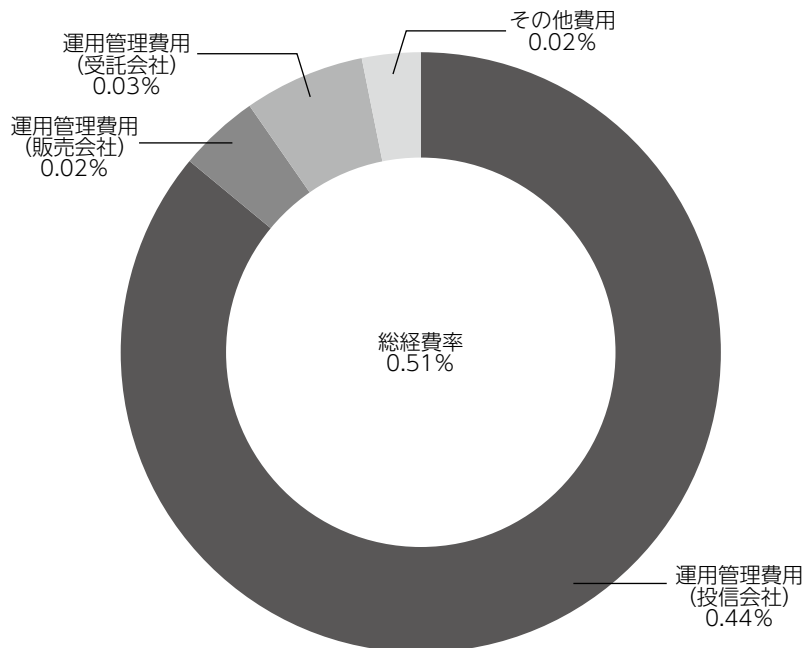
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.51%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（2019年10月16日から2020年10月12日まで）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|-----------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,011,897 | 1,957,010 | 2,613,880 | 5,010,870 |

■利害関係人との取引状況等（2019年10月16日から2020年10月12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 |
| | 千□ | 千□ | 千円 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 8,734,932 | 7,132,950 | 14,198,850 |

■投資信託財産の構成

2020年10月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 14,198,850 | 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 45,327 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 14,244,177 | 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) 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、2020年10月12日現在、129,874,234千円、99.7%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、2020年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.66円、1カナダ・ドル=80.44円、1オーストラリア・ドル=76.23円、1シンガポール・ドル=77.98円、1イギリス・ポンド=137.63円、1イスラエル・シケル=31.27円、1デンマーク・クローネ=16.77円、1ノルウェー・クローネ=11.55円、1スウェーデン・クローナ=12.00円、1メキシコ・ペソ=4.99円、1マレーシア・リンギット=25.53円、1ポーランド・ズロチ=27.91円、1ユーロ=124.78円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年10月12日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 14,244,177,719円 |
| コール・ローン等 | 42,447,428 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 14,198,850,291 |
| 未 収 入 金 | 2,880,000 |
| (B) 負 債 | 43,016,625 |
| 未 払 解 約 金 | 9,434,800 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 33,334,752 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 247,073 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 14,201,161,094 |
| 元 本 | 8,400,924,367 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 5,800,236,727 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 8,400,924,367口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D) | 16,904円 |

(注) 期首における元本額は10,237,288,201円、当期中における追加設定元本額は1,386,625,078円、同解約元本額は3,222,988,912円です。

■損益の状況

当期 自2019年10月16日 至2020年10月12日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △14,134円 |
| 受 取 利 息 | 2,171 |
| 支 払 利 息 | △16,305 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 736,616,302 |
| 売 買 益 | 819,729,785 |
| 売 買 損 | △83,113,483 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △74,733,721 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 661,868,447 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 662,146,820 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 4,476,221,460 |
| (配 当 等 相 当 額) | (4,166,435,856) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (309,785,604) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 5,800,236,727 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 5,800,236,727 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 4,476,221,460 |
| (配 当 等 相 当 額) | (4,167,771,856) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (308,449,604) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 1,324,015,267 |

(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 | 271,824,769円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 152,733,793 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 4,476,221,460 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 899,456,705 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d) | 5,800,236,727 |
| (f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額 | 6,904.28 |
| (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運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2020年2月21日）

（計算期間 2019年2月22日～2020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17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | FTSE世界国債インデックス | | 債券組入率 | 債券先物率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|------|---------------------------------|------|-------|-------|---------|
| | 円 | 騰落率 | （除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | 騰落率 | | | |
| 13期（2016年2月22日） | 17,881 | △5.0 | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 14期（2017年2月21日） | 17,364 | △2.9 | 111,769.89 | △5.0 | 97.6 | - | 267,780 |
| 15期（2018年2月21日） | 17,876 | 2.9 | 108,792.68 | △2.7 | 97.9 | - | 248,485 |
| 16期（2019年2月21日） | 18,170 | 1.6 | 111,885.82 | 2.8 | 97.7 | - | 217,863 |
| 17期（2020年2月21日） | 19,586 | 7.8 | 113,733.36 | 1.7 | 98.1 | - | 197,670 |
| | | | 122,662.63 | 7.9 | 97.8 | - | 130,803 |

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

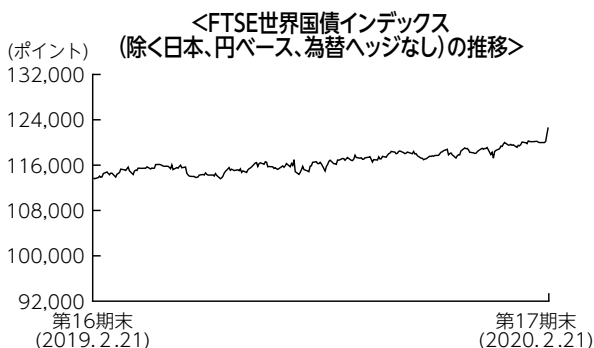
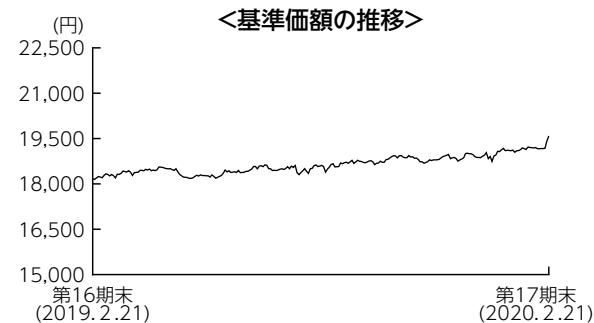
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 債券組入 比 率 | 債券先物 比 率 |
|--------------------------|---------|-----|--|-----|-------------|-------------|
| | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2019 年 2 月 21 日 | 円 | % | ポイント | % | % | % |
| | 18,170 | — | 113,733.36 | — | 98.1 | — |
| 2 月 末 | 18,204 | 0.2 | 113,937.65 | 0.2 | 98.1 | — |
| 3 月 末 | 18,446 | 1.5 | 115,474.58 | 1.5 | 97.9 | — |
| 4 月 末 | 18,395 | 1.2 | 115,213.50 | 1.3 | 97.4 | — |
| 5 月 末 | 18,249 | 0.4 | 114,188.44 | 0.4 | 98.1 | — |
| 6 月 末 | 18,486 | 1.7 | 115,685.41 | 1.7 | 97.5 | — |
| 7 月 末 | 18,542 | 2.0 | 115,950.32 | 1.9 | 97.6 | — |
| 8 月 末 | 18,666 | 2.7 | 116,876.64 | 2.8 | 97.5 | — |
| 9 月 末 | 18,755 | 3.2 | 117,408.61 | 3.2 | 97.5 | — |
| 10 月 末 | 18,937 | 4.2 | 118,313.83 | 4.0 | 97.6 | — |
| 11 月 末 | 18,947 | 4.3 | 118,546.99 | 4.2 | 97.4 | — |
| 12 月 末 | 19,033 | 4.7 | 118,980.17 | 4.6 | 96.6 | — |
| 2020 年 1 月 末 | 19,188 | 5.6 | 120,069.31 | 5.6 | 96.8 | — |
| (期 末) 2020 年 2 月 21 日 | 19,586 | 7.8 | 122,662.63 | 7.9 | 97.8 | — |

(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（2019年2月22日から2020年2月21日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は19,586円となり、前期末比で7.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国債、ドイツ債の利回りは、ともに低下（価格は上昇）しました。米中貿易摩擦やブレグジット（英国のEU離脱）等の不透明感があり、FRB（米連邦準備理事会）が政策金利を引き下げ、ECB（欧州中央銀行）も追加的に金融緩和したことから、利回りは低下しました。その後、米中貿易協議やブレグジット交渉の進展見込みから利回りは上昇（価格は下落）に転じる場面もありましたが、新型コロナウイルス感染症の流行による世界的な景気減速懸念もあり、利回りは低下しました。これらを主因に基準価額は上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、米国債、ドイツ債の利回りは、ともに低下しました。米中貿易摩擦やブレグジット等の不透明感があり、FRBが政策金利を引き下げ、ECBも追加的に金融緩和したことから、利回りは低下しました。その後、米中貿易協議やブレグジット交渉の進展見込みから利回りは上昇に転じる場面もありましたが、新型コロナウイルス感染症の流行による世界的な景気減速懸念もあり、利回りは低下しました。

為替市場ではドル／円は円安ドル高に、ユーロ／円は円高ユーロ安となりました。ドル／円は、米中貿易摩擦の激化やFRBによる政策金利の引き下げから、円高ドル安が進む展開となりました。しかし米中貿易摩擦が一時緩和し、堅調な労働市場や底堅い個人消費などを背景として緩やかに景気拡大していることから、前期末比では円安ドル高となりました。ユーロ／円は、景気減速懸念からECBが追加的な金融緩和策を実施し円高ユーロ安となりました。

ポートフォリオについて

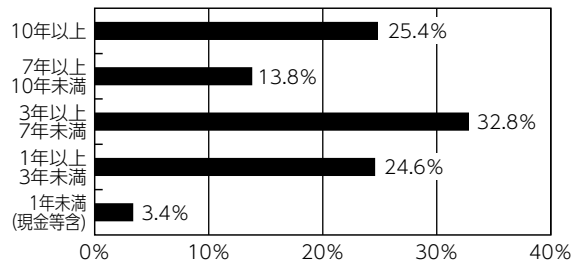
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

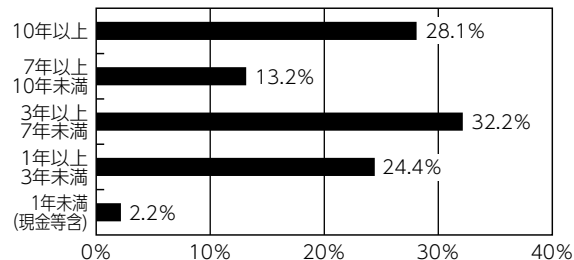
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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 | 45.6% | 45.9% | △0.3% |
| カナダ | 2.0% | 2.0% | △0.1% |
| 計 | 47.5% | 47.9% | △0.4% |
| 中南米 | | | |
| メキシコ | 0.7% | 0.8% | △0.1% |
| 計 | 0.7% | 0.8% | △0.1% |
| 欧州 | | | |
| オーストリア | 1.5% | 1.5% | △0.0% |
| ベルギー | 2.4% | 2.5% | △0.0% |
| フィンランド | 0.7% | 0.6% | 0.0% |
| フランス | 9.9% | 10.1% | △0.2% |
| ドイツ | 6.6% | 6.7% | △0.1% |
| アイルランド | 0.8% | 0.8% | 0.0% |
| イタリア | 8.6% | 9.1% | △0.5% |
| オランダ | 2.0% | 2.0% | 0.0% |
| スペイン | 5.6% | 5.9% | △0.3% |
| ユーロ計 | 38.2% | 39.1% | △1.0% |
| デンマーク | 0.5% | 0.5% | △0.0% |
| スウェーデン | 0.3% | 0.4% | △0.0% |
| 英国 | 6.7% | 6.8% | △0.1% |
| ポーランド | 0.6% | 0.6% | △0.1% |
| ノルウェー | 0.2% | 0.2% | △0.0% |
| 計 | 46.5% | 47.7% | △1.2% |
| アジア・オセアニア | | | |
| オーストラリア | 2.1% | 2.1% | △0.0% |
| シンガポール | 0.3% | 0.4% | △0.1% |
| マレーシア | 0.4% | 0.5% | △0.0% |
| 計 | 2.8% | 3.0% | △0.1% |
| アフリカ | | | |
| 南アフリカ | 0.5% | 0.6% | △0.1% |
| 計 | 0.5% | 0.6% | △0.1% |
| 現金など | 1.9% | - | - |
| 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 | 48.3% | 48.8% | △0.5% |
| カナダ | 1.8% | 1.9% | △0.1% |
| 計 | 50.1% | 50.7% | △0.6% |
| 中南米 | | | |
| メキシコ | 0.7% | 0.9% | △0.1% |
| 計 | 0.7% | 0.9% | △0.1% |
| 欧州 | | | |
| オーストリア | 1.4% | 1.4% | 0.0% |
| ベルギー | 2.3% | 2.4% | △0.1% |
| フィンランド | 0.5% | 0.6% | △0.1% |
| フランス | 9.5% | 9.8% | △0.3% |
| ドイツ | 5.7% | 6.2% | △0.5% |
| アイルランド | 0.7% | 0.7% | 0.0% |
| イタリア | 8.9% | 8.8% | 0.1% |
| オランダ | 1.8% | 1.8% | 0.0% |
| スペイン | 5.3% | 5.5% | △0.2% |
| ユーロ計 | 36.1% | 37.2% | △1.1% |
| デンマーク | 0.4% | 0.5% | 0.0% |
| スウェーデン | 0.2% | 0.3% | △0.1% |
| 英国 | 6.2% | 6.4% | △0.1% |
| ポーランド | 0.5% | 0.6% | △0.1% |
| ノルウェー | 0.2% | 0.2% | △0.1% |
| 計 | 43.7% | 45.4% | △1.8% |
| アジア・オセアニア | | | |
| オーストラリア | 1.8% | 1.9% | 0.0% |
| シンガポール | 0.4% | 0.4% | 0.0% |
| マレーシア | 0.6% | 0.5% | 0.1% |
| 計 | 2.8% | 2.8% | 0.0% |
| アフリカ | | | |
| 南アフリカ | 0.5% | 0.5% | 0.0% |
| 計 | 0.5% | 0.5% | 0.0% |
| 現金など | 1.6% | - | - |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | - |

(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7.9%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.06%と、ベンチマークにはほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------|-----|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) そ の 他 費 用 | 2円 | 0.012% |
| （保 管 費 用） | (2) | (0.012) |
| （そ の 他） | (0) | (0.000) |
| 合 計 | 2 | 0.012 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(18,642円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2019年2月22日から2020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 107,300 | 千アメリカ・ドル 405,150 |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダ・ドル 188 | 千カナダ・ドル 19,520 |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル 3,427 | 千オーストラリア・ドル 25,741 |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポール・ドル - | 千シンガポール・ドル 2,415 |
| | イギリス | 国債証券 | 千イギリス・ポンド 2,451 | 千イギリス・ポンド 44,126 |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーク・クローネ - | 千デンマーク・クローネ 25,089 |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ - | 千ノルウェー・クローネ 10,045 |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデン・クローナ 14,936 | 千スウェーデン・クローナ 47,435 |
| | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ 8,060 | 千メキシコ・ペソ 117,770 |
| | マレーシア | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット - | 千マレーシア・リンギット 2,205 |
| | 南アフリカ | 国債証券 | 千南アフリカ・ランド - | 千南アフリカ・ランド 42,074 |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ 1,276 | 千ポーランド・ズロチ 15,660 |
| 国 | ユーロ圏 | アイルランド | 千ユーロ 833 | 千ユーロ 6,664 |
| | | オランダ | 1,643 | 14,408 |
| | | ベルギー | 1,491 | 17,459 |
| | | フランス | 13,545 | 74,730 |
| | | ドイツ | 5,785 | 51,063 |
| | | スペイン | 3,915 | 41,082 |
| | | イタリア | 9,222 | 62,374 |
| | | フィンランド | 380 | 5,630 |
| オーストリア | 1,021 | 10,482 | | |

(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 (2019年2月22日から2020年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | | |
|---------|------------------------|------------------------|-------------------|-----------|--------------------|-----------|-----------|-----------|--|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うち B B 格 以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 | |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル 526,820 | 千アメリカ・ドル 563,002 | 千円 63,118,202 | % 48.3 | % - | % 21.3 | % 16.2 | % 10.7 | |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 24,880 | 千カナダ・ドル 28,099 | 千円 2,377,248 | 1.8 | - | 0.9 | 0.5 | 0.3 | |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 27,560 | 千オーストラリア・ドル 32,336 | 千円 2,399,708 | 1.8 | - | 1.4 | 0.4 | 0.1 | |
| シンガポール | 千シンガポール・ドル 5,480 | 千シンガポール・ドル 5,986 | 千円 479,318 | 0.4 | - | 0.2 | 0.1 | - | |
| イギリス | 千イギリス・ポンド 41,680 | 千イギリス・ポンド 56,394 | 千円 8,145,652 | 6.2 | - | 5.1 | 1.1 | - | |
| デンマーク | 千デンマーク・クローネ 26,340 | 千デンマーク・クローネ 35,998 | 千円 582,823 | 0.4 | - | 0.4 | 0.1 | - | |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 19,810 | 千ノルウェー・クローネ 20,550 | 千円 247,224 | 0.2 | - | 0.1 | 0.1 | - | |
| スウェーデン | 千スウェーデン・クローナ 19,610 | 千スウェーデン・クローナ 23,326 | 千円 266,391 | 0.2 | - | 0.2 | - | - | |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 145,488 | 千メキシコ・ペソ 161,587 | 千円 961,447 | 0.7 | - | 0.5 | 0.2 | - | |
| マレーシア | 千マレーシア・リンギット 27,550 | 千マレーシア・リンギット 29,527 | 千円 789,861 | 0.6 | - | 0.4 | 0.1 | 0.1 | |
| 南アフリカ | 千南アフリカ・ランド 103,700 | 千南アフリカ・ランド 95,743 | 千円 710,419 | 0.5 | - | 0.5 | 0.0 | - | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 22,900 | 千ポーランド・ズロチ 24,360 | 千円 688,666 | 0.5 | - | 0.2 | 0.3 | - | |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | | | | |
| アイルランド | 6,250 | 7,364 | 890,608 | 0.7 | - | 0.5 | 0.1 | - | |
| オランダ | 16,070 | 19,688 | 2,380,903 | 1.8 | - | 1.2 | 0.4 | 0.2 | |
| ベルギー | 19,580 | 25,047 | 3,029,029 | 2.3 | - | 1.7 | 0.5 | 0.1 | |
| フランス | 83,180 | 102,810 | 12,432,844 | 9.5 | - | 6.5 | 2.5 | 0.5 | |
| ドイツ | 50,000 | 61,740 | 7,466,249 | 5.7 | - | 3.4 | 1.9 | 0.4 | |
| スペイン | 45,890 | 57,054 | 6,899,589 | 5.3 | - | 3.8 | 1.2 | 0.3 | |
| イタリア | 81,140 | 96,539 | 11,674,496 | 8.9 | - | 5.3 | 2.4 | 1.2 | |
| フィンランド | 4,710 | 5,396 | 652,595 | 0.5 | - | 0.4 | 0.1 | - | |
| オーストリア | 11,670 | 14,712 | 1,779,149 | 1.4 | - | 0.9 | 0.3 | 0.1 | |
| 合 計 | - | - | 千円 127,972,430 | 97.8 | - | 55.0 | 28.6 | 14.2 | |

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘柄 | 当 | | | | 期 | | 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 2.625 01/31/26 | 国債証券 | 2.6250 | 2,180 | 2,329 | 261,202 | 2026/01/31 | |
| US T N/B 2.25 01/31/24 | 国債証券 | 2.2500 | 350 | 361 | 40,575 | 2024/01/31 | |
| US T N/B 1.75 01/31/23 | 国債証券 | 1.7500 | 4,980 | 5,034 | 564,457 | 2023/01/31 | |
| US T N/B 2.5 01/31/24 | 国債証券 | 2.5000 | 3,890 | 4,059 | 455,085 | 2024/01/31 | |
| US T N/B 2.5 01/15/22 | 国債証券 | 2.5000 | 3,850 | 3,928 | 440,373 | 2022/01/15 | |
| US T N/B 1.375 01/31/25 | 国債証券 | 1.3750 | 3,280 | 3,280 | 367,806 | 2025/01/31 | |
| US T N/B 6.0 02/15/26 | 国債証券 | 6.0000 | 840 | 1,062 | 119,172 | 2026/02/15 | |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 国債証券 | 3.1250 | 1,380 | 1,682 | 188,591 | 2042/02/15 | |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 国債証券 | 3.1250 | 1,440 | 1,754 | 196,702 | 2043/02/15 | |
| US T N/B 2.5 02/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 1,970 | 2,175 | 243,891 | 2046/02/15 | |
| US T N/B 3.5 02/15/39 | 国債証券 | 3.5000 | 900 | 1,149 | 128,819 | 2039/02/15 | |
| US T N/B 5.25 02/15/29 | 国債証券 | 5.2500 | 490 | 644 | 72,276 | 2029/02/15 | |
| US T N/B 5.375 02/15/31 | 国債証券 | 5.3750 | 1,000 | 1,386 | 155,491 | 2031/02/15 | |
| US T N/B 4.5 02/15/36 | 国債証券 | 4.5000 | 730 | 1,017 | 114,058 | 2036/02/15 | |
| US T N/B 4.75 02/15/41 | 国債証券 | 4.7500 | 1,200 | 1,804 | 202,260 | 2041/02/15 | |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 国債証券 | 3.6250 | 2,790 | 3,680 | 412,658 | 2044/02/15 | |
| US T N/B 3.0 02/15/49 | 国債証券 | 3.0000 | 3,070 | 3,768 | 422,451 | 2049/02/15 | |
| US T N/B 2.0 02/15/22 | 国債証券 | 2.0000 | 8,470 | 8,570 | 960,884 | 2022/02/15 | |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 国債証券 | 4.3750 | 550 | 774 | 86,816 | 2038/02/15 | |
| US T N/B 4.625 02/15/40 | 国債証券 | 4.6250 | 750 | 1,103 | 123,758 | 2040/02/15 | |
| US T N/B 1.625 02/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 4,180 | 4,228 | 474,074 | 2026/02/15 | |
| US T N/B 2.5 02/15/45 | 国債証券 | 2.5000 | 2,840 | 3,129 | 350,903 | 2045/02/15 | |
| US T N/B 3.0 02/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 2,540 | 3,086 | 346,071 | 2047/02/15 | |
| US T N/B 3.0 02/15/48 | 国債証券 | 3.0000 | 3,110 | 3,794 | 425,422 | 2048/02/15 | |
| US T N/B 2.75 02/15/24 | 国債証券 | 2.7500 | 5,320 | 5,605 | 628,389 | 2024/02/15 | |
| US T N/B 2.0 02/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 5,300 | 5,458 | 611,915 | 2025/02/15 | |
| US T N/B 2.625 02/15/29 | 国債証券 | 2.6250 | 5,130 | 5,610 | 628,952 | 2029/02/15 | |
| US T N/B 2.75 02/15/28 | 国債証券 | 2.7500 | 4,370 | 4,789 | 536,960 | 2028/02/15 | |
| US T N/B 2.0 02/15/23 | 国債証券 | 2.0000 | 4,370 | 4,451 | 499,068 | 2023/02/15 | |
| US T N/B 2.25 02/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 4,670 | 4,916 | 551,244 | 2027/02/15 | |
| US T N/B 2.125 02/29/24 | 国債証券 | 2.1250 | 1,300 | 1,338 | 150,035 | 2024/02/29 | |
| US T N/B 2.5 02/28/26 | 国債証券 | 2.5000 | 2,550 | 2,708 | 303,681 | 2026/02/28 | |
| US T N/B 2.75 02/28/25 | 国債証券 | 2.7500 | 3,510 | 3,743 | 419,668 | 2025/02/28 | |
| US T N/B 1.875 02/28/22 | 国債証券 | 1.8750 | 1,680 | 1,696 | 190,139 | 2022/02/28 | |
| US T N/B 2.5 02/15/22 | 国債証券 | 2.5000 | 1,070 | 1,092 | 122,530 | 2022/02/15 | |
| US T N/B 1.125 02/28/21 | 国債証券 | 1.1250 | 3,680 | 3,667 | 411,114 | 2021/02/28 | |
| US T N/B 2.125 03/31/24 | 国債証券 | 2.1250 | 4,080 | 4,202 | 471,166 | 2024/03/31 | |
| US T N/B 1.75 03/31/22 | 国債証券 | 1.7500 | 6,990 | 7,042 | 789,587 | 2022/03/31 | |
| US T N/B 2.25 03/31/21 | 国債証券 | 2.2500 | 9,760 | 9,842 | 1,103,425 | 2021/03/31 | |
| US T N/B 2.625 03/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 2,150 | 2,281 | 255,762 | 2025/03/31 | |
| US T N/B 2.25 03/31/26 | 国債証券 | 2.2500 | 3,090 | 3,239 | 363,172 | 2026/03/31 | |
| US T N/B 2.5 03/31/23 | 国債証券 | 2.5000 | 1,020 | 1,055 | 118,309 | 2023/03/31 | |
| US T N/B 2.25 04/30/21 | 国債証券 | 2.2500 | 8,170 | 8,244 | 924,346 | 2021/04/30 | |
| US T N/B 1.375 04/30/21 | 国債証券 | 1.3750 | 11,210 | 11,197 | 1,255,329 | 2021/04/30 | |
| US T N/B 2.375 04/30/26 | 国債証券 | 2.3750 | 1,760 | 1,858 | 208,397 | 2026/04/30 | |

| 銘柄 | 当 | 種 | 類 | 利 | 率 | 額 | 面 | 金 | 額 | 期 | | 末 | | |
|-------------------------|---|---|---|---|---|--------|--------|---|--------|---|-----------|------------|---|---|
| | | | | | | | | | | 評 | | | 額 | 償 |
| | | | | | | | | | | 外 | 貨 | | | |
| (アメリカ) | | | | | % | 千 | ア | メ | リ | カ | ・ | ド | | |
| US T N/B 2.75 04/30/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 2,490 | | 2,597 | | 291,170 | 2023/04/30 | | |
| US T N/B 2.25 04/30/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500 | 3,300 | | 3,417 | | 383,142 | 2024/04/30 | | |
| US T N/B 6.25 05/15/30 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.2500 | 710 | | 1,027 | | 115,233 | 2030/05/15 | | |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.3750 | 1,300 | | 1,859 | | 208,492 | 2040/05/15 | | |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.3750 | 1,040 | | 1,496 | | 167,722 | 2041/05/15 | | |
| US T N/B 3.0 05/15/42 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 | 980 | | 1,171 | | 131,360 | 2042/05/15 | | |
| US T N/B 4.25 05/15/39 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500 | 810 | | 1,134 | | 127,196 | 2039/05/15 | | |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 | 2,720 | | 3,188 | | 357,493 | 2043/05/15 | | |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.3750 | 2,420 | | 3,078 | | 345,131 | 2044/05/15 | | |
| US T N/B 3.0 05/15/45 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 | 2,500 | | 3,007 | | 337,162 | 2045/05/15 | | |
| US T N/B 3.0 05/15/47 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 | 2,350 | | 2,857 | | 320,369 | 2047/05/15 | | |
| US T N/B 2.5 05/15/46 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | 2,790 | | 3,083 | | 345,702 | 2046/05/15 | | |
| US T N/B 3.125 05/15/48 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1250 | 2,660 | | 3,323 | | 372,556 | 2048/05/15 | | |
| US T N/B 1.75 05/15/22 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 5,400 | | 5,444 | | 610,360 | 2022/05/15 | | |
| US T N/B 2.875 05/15/49 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 | 3,700 | | 4,443 | | 498,157 | 2049/05/15 | | |
| US T N/B 4.5 05/15/38 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.5000 | 700 | | 1,000 | | 112,209 | 2038/05/15 | | |
| US T N/B 1.75 05/15/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 5,990 | | 6,063 | | 679,723 | 2023/05/15 | | |
| US T N/B 2.5 05/15/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | 6,240 | | 6,529 | | 731,975 | 2024/05/15 | | |
| US T N/B 3.125 05/15/21 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1250 | 8,000 | | 8,160 | | 914,922 | 2021/05/15 | | |
| US T N/B 2.125 05/15/25 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1250 | 5,150 | | 5,341 | | 598,792 | 2025/05/15 | | |
| US T N/B 2.875 05/15/28 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 | 4,430 | | 4,906 | | 550,075 | 2028/05/15 | | |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750 | 4,840 | | 5,196 | | 582,630 | 2029/05/15 | | |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.3750 | 3,100 | | 3,295 | | 369,452 | 2027/05/15 | | |
| US T N/B 5.0 05/15/37 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.0000 | 500 | | 745 | | 83,578 | 2037/05/15 | | |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6250 | 4,290 | | 4,339 | | 486,512 | 2026/05/15 | | |
| US T N/B 2.0 05/31/21 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | 10,130 | | 10,197 | | 1,143,260 | 2021/05/31 | | |
| US T N/B 1.625 05/31/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.6250 | 2,900 | | 2,924 | | 327,887 | 2023/05/31 | | |
| US T N/B 2.0 05/31/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | 4,770 | | 4,893 | | 548,635 | 2024/05/31 | | |
| US T N/B 2.125 05/31/26 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1250 | 2,050 | | 2,135 | | 239,395 | 2026/05/31 | | |
| US T N/B 2.75 05/31/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 3,270 | | 3,414 | | 382,781 | 2023/05/31 | | |
| US T N/B 2.875 05/31/25 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 | 2,530 | | 2,720 | | 305,021 | 2025/05/31 | | |
| US T N/B 1.375 06/30/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3750 | 3,460 | | 3,462 | | 388,233 | 2023/06/30 | | |
| US T N/B 2.125 06/30/22 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1250 | 6,530 | | 6,642 | | 744,718 | 2022/06/30 | | |
| US T N/B 2.75 06/30/25 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 790 | | 845 | | 94,773 | 2025/06/30 | | |
| US T N/B 1.875 06/30/26 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750 | 720 | | 739 | | 82,894 | 2026/06/30 | | |
| US T N/B 2.625 06/30/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.6250 | 1,820 | | 1,895 | | 212,472 | 2023/06/30 | | |
| US T N/B 1.75 06/30/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 1,340 | | 1,361 | | 152,621 | 2024/06/30 | | |
| US T N/B 1.75 06/15/22 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 830 | | 837 | | 93,847 | 2022/06/15 | | |
| US T N/B 2.875 07/31/25 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.8750 | 3,390 | | 3,652 | | 409,506 | 2025/07/31 | | |
| US T N/B 1.875 07/31/26 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.8750 | 2,370 | | 2,434 | | 272,903 | 2026/07/31 | | |
| US T N/B 1.75 07/31/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 3,690 | | 3,749 | | 420,408 | 2024/07/31 | | |
| US T N/B 2.75 07/31/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 3,270 | | 3,422 | | 383,640 | 2023/07/31 | | |
| US T N/B 6.25 08/15/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.2500 | 1,000 | | 1,165 | | 130,695 | 2023/08/15 | | |
| US T N/B 3.75 08/15/41 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.7500 | 410 | | 544 | | 61,058 | 2041/08/15 | | |
| US T N/B 5.5 08/15/28 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.5000 | 650 | | 858 | | 96,253 | 2028/08/15 | | |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.8750 | 1,110 | | 1,493 | | 167,452 | 2040/08/15 | | |
| US T N/B 2.75 08/15/42 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 1,800 | | 2,068 | | 231,925 | 2042/08/15 | | |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.1250 | 2,830 | | 3,465 | | 388,483 | 2044/08/15 | | |

| 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 4.5 08/15/39 | 国債証券 | 4.5000 | 790 | 1,141 | 127,937 | 2039/08/15 | |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国債証券 | 3.6250 | 1,670 | 2,198 | 246,491 | 2043/08/15 | |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 国債証券 | 2.8750 | 2,090 | 2,464 | 276,266 | 2045/08/15 | |
| US T N/B 2.0 08/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 5,180 | 5,344 | 599,195 | 2025/08/15 | |
| US T N/B 2.75 08/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 770 | 896 | 100,453 | 2047/08/15 | |
| US T N/B 2.25 08/15/49 | 国債証券 | 2.2500 | 2,400 | 2,548 | 285,754 | 2049/08/15 | |
| US T N/B 2.125 08/15/21 | 国債証券 | 2.1250 | 11,000 | 11,108 | 1,245,397 | 2021/08/15 | |
| US T N/B 2.5 08/15/23 | 国債証券 | 2.5000 | 4,330 | 4,498 | 504,322 | 2023/08/15 | |
| US T N/B 2.375 08/15/24 | 国債証券 | 2.3750 | 6,110 | 6,376 | 714,906 | 2024/08/15 | |
| US T N/B 2.25 08/15/46 | 国債証券 | 2.2500 | 2,720 | 2,867 | 321,496 | 2046/08/15 | |
| US T N/B 3.0 08/15/48 | 国債証券 | 3.0000 | 3,210 | 3,927 | 440,366 | 2048/08/15 | |
| US T N/B 2.25 08/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 2,690 | 2,840 | 318,421 | 2027/08/15 | |
| US T N/B 1.5 08/15/26 | 国債証券 | 1.5000 | 4,290 | 4,306 | 482,793 | 2026/08/15 | |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 4,680 | 5,194 | 582,348 | 2028/08/15 | |
| US T N/B 1.625 08/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 3,980 | 4,005 | 449,038 | 2022/08/15 | |
| US T N/B 2.75 08/31/25 | 国債証券 | 2.7500 | 1,640 | 1,757 | 197,046 | 2025/08/31 | |
| US T N/B 1.625 08/15/29 | 国債証券 | 1.6250 | 4,380 | 4,419 | 495,453 | 2029/08/15 | |
| US T N/B 1.875 08/31/22 | 国債証券 | 1.8750 | 3,680 | 3,726 | 417,721 | 2022/08/31 | |
| US T N/B 1.875 08/31/24 | 国債証券 | 1.8750 | 3,120 | 3,188 | 357,434 | 2024/08/31 | |
| US T N/B 2.75 08/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | 2,170 | 2,273 | 254,834 | 2023/08/31 | |
| US T N/B 1.5 08/15/22 | 国債証券 | 1.5000 | 1,210 | 1,213 | 136,050 | 2022/08/15 | |
| US T N/B 1.375 08/31/26 | 国債証券 | 1.3750 | 1,100 | 1,095 | 122,848 | 2026/08/31 | |
| US T N/B 1.25 08/31/24 | 国債証券 | 1.2500 | 2,440 | 2,427 | 272,116 | 2024/08/31 | |
| US T N/B 3.0 09/30/25 | 国債証券 | 3.0000 | 1,410 | 1,531 | 171,659 | 2025/09/30 | |
| US T N/B 2.125 09/30/21 | 国債証券 | 2.1250 | 8,840 | 8,935 | 1,001,814 | 2021/09/30 | |
| US T N/B 2.125 09/30/24 | 国債証券 | 2.1250 | 2,930 | 3,028 | 339,491 | 2024/09/30 | |
| US T N/B 1.375 09/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 3,100 | 3,101 | 347,676 | 2023/09/30 | |
| US T N/B 1.75 09/30/22 | 国債証券 | 1.7500 | 5,250 | 5,300 | 594,279 | 2022/09/30 | |
| US T N/B 2.875 09/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | 840 | 884 | 99,167 | 2023/09/30 | |
| US T N/B 1.5 09/15/22 | 国債証券 | 1.5000 | 750 | 752 | 84,348 | 2022/09/15 | |
| US T N/B 1.5 09/30/21 | 国債証券 | 1.5000 | 5,120 | 5,125 | 574,608 | 2021/09/30 | |
| US T N/B 3.0 10/31/25 | 国債証券 | 3.0000 | 1,920 | 2,086 | 233,967 | 2025/10/31 | |
| US T N/B 2.875 10/31/23 | 国債証券 | 2.8750 | 3,690 | 3,889 | 436,050 | 2023/10/31 | |
| US T N/B 1.625 10/31/26 | 国債証券 | 1.6250 | 2,350 | 2,376 | 266,484 | 2026/10/31 | |
| US T N/B 8.0 11/15/21 | 国債証券 | 8.0000 | 6,000 | 6,673 | 748,202 | 2021/11/15 | |
| US T N/B 5.25 11/15/28 | 国債証券 | 5.2500 | 850 | 1,111 | 124,626 | 2028/11/15 | |
| US T N/B 6.125 11/15/27 | 国債証券 | 6.1250 | 900 | 1,209 | 135,598 | 2027/11/15 | |
| US T N/B 3.0 11/15/44 | 国債証券 | 3.0000 | 2,290 | 2,749 | 308,278 | 2044/11/15 | |
| US T N/B 4.25 11/15/40 | 国債証券 | 4.2500 | 1,110 | 1,567 | 175,716 | 2040/11/15 | |
| US T N/B 2.75 11/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 2,110 | 2,423 | 271,683 | 2042/11/15 | |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 国債証券 | 3.1250 | 760 | 925 | 103,748 | 2041/11/15 | |
| US T N/B 3.75 11/15/43 | 国債証券 | 3.7500 | 2,620 | 3,515 | 394,077 | 2043/11/15 | |
| US T N/B 2.75 11/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 2,640 | 3,074 | 344,689 | 2047/11/15 | |
| US T N/B 3.0 11/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 1,630 | 1,965 | 220,386 | 2045/11/15 | |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 国債証券 | 2.8750 | 2,220 | 2,633 | 295,258 | 2046/11/15 | |
| US T N/B 2.25 11/15/24 | 国債証券 | 2.2500 | 4,690 | 4,878 | 546,909 | 2024/11/15 | |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 国債証券 | 4.3750 | 410 | 584 | 65,525 | 2039/11/15 | |
| US T N/B 3.375 11/15/48 | 国債証券 | 3.3750 | 3,330 | 4,359 | 488,736 | 2048/11/15 | |

| 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 2.375 11/15/49 | 国債証券 | 2.3750 | 2,770 | 3,022 | 338,809 | 2049/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/21 | 国債証券 | 2.0000 | 10,400 | 10,504 | 1,177,648 | 2021/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/25 | 国債証券 | 2.2500 | 5,190 | 5,430 | 608,761 | 2025/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/28 | 国債証券 | 3.1250 | 4,840 | 5,481 | 614,550 | 2028/11/15 |
| US T N/B 1.625 11/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 5,620 | 5,657 | 634,316 | 2022/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/23 | 国債証券 | 2.7500 | 6,020 | 6,323 | 708,963 | 2023/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/26 | 国債証券 | 2.0000 | 4,140 | 4,286 | 480,525 | 2026/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/30/22 | 国債証券 | 2.0000 | 6,590 | 6,702 | 751,387 | 2022/11/30 |
| US T N/B 2.25 11/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 4,040 | 4,270 | 478,755 | 2027/11/15 |
| US T N/B 2.875 11/30/25 | 国債証券 | 2.8750 | 3,480 | 3,762 | 421,780 | 2025/11/30 |
| US T N/B 2.875 11/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | 5,640 | 5,951 | 667,274 | 2023/11/30 |
| US T N/B 2.875 11/15/21 | 国債証券 | 2.8750 | 4,880 | 5,000 | 560,624 | 2021/11/15 |
| US T N/B 1.75 11/15/29 | 国債証券 | 1.7500 | 2,400 | 2,448 | 274,445 | 2029/11/15 |
| US T N/B 2.25 12/31/23 | 国債証券 | 2.2500 | 4,830 | 4,991 | 559,597 | 2023/12/31 |
| US T N/B 2.625 12/31/23 | 国債証券 | 2.6250 | 3,060 | 3,203 | 359,190 | 2023/12/31 |
| US T N/B 2.625 12/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 2,290 | 2,446 | 274,261 | 2025/12/31 |
| US T N/B 2.125 12/31/21 | 国債証券 | 2.1250 | 9,160 | 9,279 | 1,040,325 | 2021/12/31 |
| US T N/B 2.125 12/31/22 | 国債証券 | 2.1250 | 5,520 | 5,636 | 631,949 | 2022/12/31 |
| US T N/B 2.625 12/15/21 | 国債証券 | 2.6250 | 3,770 | 3,851 | 431,751 | 2021/12/15 |
| US T N/B 1.75 12/31/26 | 国債証券 | 1.7500 | 740 | 754 | 84,588 | 2026/12/31 |
| 小計 | — | — | 526,820 | 563,002 | 63,118,202 | — |
| (カナダ) | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CANADA 2.25 03/01/24 | 国債証券 | 2.2500 | 530 | 548 | 46,416 | 2024/03/01 |
| CANADA 1.75 03/01/23 | 国債証券 | 1.7500 | 1,160 | 1,171 | 99,128 | 2023/03/01 |
| CANADA 1.5 06/01/26 | 国債証券 | 1.5000 | 800 | 808 | 68,387 | 2026/06/01 |
| CANADA 8.0 06/01/27 | 国債証券 | 8.0000 | 230 | 335 | 28,371 | 2027/06/01 |
| CANADA 5.75 06/01/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,100 | 1,519 | 128,577 | 2029/06/01 |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 720 | 1,101 | 93,205 | 2033/06/01 |
| CANADA 5.0 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 870 | 1,347 | 114,029 | 2037/06/01 |
| CANADA 2.5 06/01/24 | 国債証券 | 2.5000 | 1,600 | 1,676 | 141,799 | 2024/06/01 |
| CANADA 4.0 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 880 | 1,293 | 109,452 | 2041/06/01 |
| CANADA 3.25 06/01/21 | 国債証券 | 3.2500 | 4,700 | 4,801 | 406,168 | 2021/06/01 |
| CANADA 2.75 06/01/22 | 国債証券 | 2.7500 | 2,240 | 2,305 | 195,010 | 2022/06/01 |
| CANADA 1.5 06/01/23 | 国債証券 | 1.5000 | 1,210 | 1,214 | 102,704 | 2023/06/01 |
| CANADA 2.0 06/01/28 | 国債証券 | 2.0000 | 1,020 | 1,073 | 90,824 | 2028/06/01 |
| CANADA 2.25 06/01/25 | 国債証券 | 2.2500 | 1,500 | 1,570 | 132,873 | 2025/06/01 |
| CANADA 1.0 06/01/27 | 国債証券 | 1.0000 | 800 | 781 | 66,143 | 2027/06/01 |
| CANADA 2.25 06/01/29 | 国債証券 | 2.2500 | 610 | 659 | 55,814 | 2029/06/01 |
| CANADA 0.75 09/01/21 | 国債証券 | 0.7500 | 600 | 593 | 50,204 | 2021/09/01 |
| CANADA 2.0 09/01/23 | 国債証券 | 2.0000 | 740 | 755 | 63,915 | 2023/09/01 |
| CANADA 1.0 09/01/22 | 国債証券 | 1.0000 | 800 | 791 | 66,974 | 2022/09/01 |
| CANADA 3.5 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 1,020 | 1,473 | 124,634 | 2045/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/48 | 国債証券 | 2.7500 | 980 | 1,285 | 108,783 | 2048/12/01 |
| CANADA 2.0 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 420 | 483 | 40,925 | 2051/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 350 | 507 | 42,903 | 2064/12/01 |
| 小計 | — | — | 24,880 | 28,099 | 2,377,248 | — |
| (オーストラリア) | | % | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円 | |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47 | 国債証券 | 3.0000 | 870 | 1,138 | 84,513 | 2047/03/21 |

| 銘柄 | 種類 | 当 利率 | 期 額面金額 | 評 価 額 | | 末 償還年月日 |
|---------------------------|------|---------|-----------|-------------|-----------|------------|
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | | 千オーストラリア・ドル | 千円 | |
| (オーストラリア) | | | | | | |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/25 | 国債証券 | 3.2500 | 1,520 | 1,711 | 127,029 | 2025/04/21 |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 国債証券 | 4.7500 | 1,670 | 2,120 | 157,348 | 2027/04/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 国債証券 | 2.7500 | 1,980 | 2,145 | 159,213 | 2024/04/21 |
| AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 | 国債証券 | 4.2500 | 2,010 | 2,425 | 179,994 | 2026/04/21 |
| AUSTRALIAN 5.5 04/21/23 | 国債証券 | 5.5000 | 1,710 | 1,966 | 145,970 | 2023/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 2,820 | 3,381 | 250,929 | 2029/04/21 |
| AUSTRALIAN 4.5 04/21/33 | 国債証券 | 4.5000 | 1,130 | 1,602 | 118,923 | 2033/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 850 | 1,170 | 86,859 | 2037/04/21 |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 1,740 | 1,925 | 142,877 | 2028/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30 | 国債証券 | 2.5000 | 1,200 | 1,374 | 102,011 | 2030/05/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 720 | 946 | 70,214 | 2039/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 530 | 644 | 47,800 | 2035/06/21 |
| AUSTRALIAN 5.75 07/15/22 | 国債証券 | 5.7500 | 1,180 | 1,321 | 98,048 | 2022/07/15 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28 | 国債証券 | 2.7500 | 2,080 | 2,392 | 177,546 | 2028/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27 | 国債証券 | 2.7500 | 1,330 | 1,511 | 112,141 | 2027/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 国債証券 | 2.7500 | 1,560 | 1,819 | 134,996 | 2029/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.25 11/21/22 | 国債証券 | 2.2500 | 890 | 927 | 68,866 | 2022/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.0 12/21/21 | 国債証券 | 2.0000 | 1,770 | 1,811 | 134,421 | 2021/12/21 |
| 小計 | — | — | 27,560 | 32,336 | 2,399,708 | — |
| (シンガポール) | | | | | | |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27 | 国債証券 | 3.5000 | 730 | 823 | 65,903 | 2027/03/01 |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46 | 国債証券 | 2.7500 | 420 | 483 | 38,690 | 2046/03/01 |
| SINGAPORE 2.75 04/01/42 | 国債証券 | 2.7500 | 380 | 437 | 35,066 | 2042/04/01 |
| SINGAPORE 2.375 06/01/25 | 国債証券 | 2.3750 | 340 | 354 | 28,402 | 2025/06/01 |
| SINGAPORE 2.125 06/01/26 | 国債証券 | 2.1250 | 210 | 217 | 17,396 | 2026/06/01 |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29 | 国債証券 | 2.8750 | 200 | 221 | 17,712 | 2029/07/01 |
| SINGAPORE 2.25 08/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 200 | 213 | 17,062 | 2036/08/01 |
| SINGAPORE 3.0 09/01/24 | 国債証券 | 3.0000 | 550 | 586 | 46,927 | 2024/09/01 |
| SINGAPORE 3.125 09/01/22 | 国債証券 | 3.1250 | 1,600 | 1,664 | 133,300 | 2022/09/01 |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30 | 国債証券 | 2.8750 | 370 | 412 | 33,018 | 2030/09/01 |
| SINGAPORE 3.375 09/01/33 | 国債証券 | 3.3750 | 480 | 572 | 45,836 | 2033/09/01 |
| 小計 | — | — | 5,480 | 5,986 | 479,318 | — |
| (イギリス) | | | | | | |
| UK TREASURY 3.25 01/22/44 | 国債証券 | 3.2500 | 1,540 | 2,254 | 325,670 | 2044/01/22 |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45 | 国債証券 | 3.5000 | 1,280 | 1,965 | 283,925 | 2045/01/22 |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60 | 国債証券 | 4.0000 | 990 | 1,995 | 288,250 | 2060/01/22 |
| UK TREASURY 1.75 01/22/49 | 国債証券 | 1.7500 | 580 | 680 | 98,318 | 2049/01/22 |
| UK TREASURY 5.0 03/07/25 | 国債証券 | 5.0000 | 1,610 | 1,974 | 285,167 | 2025/03/07 |
| UK TREASURY 4.0 03/07/22 | 国債証券 | 4.0000 | 1,040 | 1,114 | 160,977 | 2022/03/07 |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36 | 国債証券 | 4.2500 | 1,130 | 1,700 | 245,625 | 2036/03/07 |
| UK TREASURY 1.0 04/22/24 | 国債証券 | 1.0000 | 820 | 838 | 121,090 | 2024/04/22 |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32 | 国債証券 | 4.2500 | 1,110 | 1,573 | 227,233 | 2032/06/07 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/47 | 国債証券 | 1.5000 | 1,450 | 1,604 | 231,722 | 2047/07/22 |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52 | 国債証券 | 3.7500 | 1,120 | 1,968 | 284,348 | 2052/07/22 |
| UK TREASURY 1.75 07/22/57 | 国債証券 | 1.7500 | 1,020 | 1,273 | 183,998 | 2057/07/22 |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65 | 国債証券 | 2.5000 | 1,130 | 1,785 | 257,902 | 2065/07/22 |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68 | 国債証券 | 3.5000 | 890 | 1,780 | 257,218 | 2068/07/22 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/26 | 国債証券 | 1.5000 | 900 | 960 | 138,739 | 2026/07/22 |

| 銘柄 | 種類 | 当 | 利率 | 額面金額 | 期 | | 末 | |
|-----------------------------|------|---|--------|--------------|--------------|-----------|------------|-------|
| | | | | | 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 1.25 07/22/27 | 国債証券 | | 1.2500 | 960 | 1,014 | 146,584 | 2027/07/22 | |
| UK TREASURY 0.5 07/22/22 | 国債証券 | | 0.5000 | 1,920 | 1,922 | 277,671 | 2022/07/22 | |
| UK TREASURY 0.75 07/22/23 | 国債証券 | | 0.7500 | 1,560 | 1,575 | 227,575 | 2023/07/22 | |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39 | 国債証券 | | 4.2500 | 920 | 1,458 | 210,728 | 2039/09/07 | |
| UK TREASURY 2.25 09/07/23 | 国債証券 | | 2.2500 | 1,180 | 1,254 | 181,220 | 2023/09/07 | |
| UK TREASURY 2.75 09/07/24 | 国債証券 | | 2.7500 | 1,380 | 1,522 | 219,923 | 2024/09/07 | |
| UK TREASURY 2.0 09/07/25 | 国債証券 | | 2.0000 | 790 | 858 | 124,071 | 2025/09/07 | |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34 | 国債証券 | | 4.5000 | 900 | 1,356 | 195,903 | 2034/09/07 | |
| UK TREASURY 1.75 09/07/37 | 国債証券 | | 1.7500 | 1,540 | 1,739 | 251,221 | 2037/09/07 | |
| UK TREASURY 1.75 09/07/22 | 国債証券 | | 1.7500 | 1,530 | 1,580 | 228,255 | 2022/09/07 | |
| UK TREASURY 1.625 10/22/54 | 国債証券 | | 1.6250 | 510 | 603 | 87,188 | 2054/10/22 | |
| UK TREASURY 1.625 10/22/71 | 国債証券 | | 1.6250 | 580 | 754 | 108,964 | 2071/10/22 | |
| UK TREASURY 1.625 10/22/28 | 国債証券 | | 1.6250 | 1,830 | 2,002 | 289,220 | 2028/10/22 | |
| UK TREASURY 0.875 10/22/29 | 国債証券 | | 0.8750 | 430 | 441 | 63,841 | 2029/10/22 | |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28 | 国債証券 | | 6.0000 | 760 | 1,118 | 161,619 | 2028/12/07 | |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 国債証券 | | 4.7500 | 990 | 1,642 | 237,229 | 2038/12/07 | |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42 | 国債証券 | | 4.5000 | 1,080 | 1,842 | 266,174 | 2042/12/07 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46 | 国債証券 | | 4.2500 | 1,170 | 2,042 | 295,031 | 2046/12/07 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 国債証券 | | 4.2500 | 1,000 | 1,987 | 287,074 | 2055/12/07 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27 | 国債証券 | | 4.2500 | 970 | 1,250 | 180,594 | 2027/12/07 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40 | 国債証券 | | 4.2500 | 960 | 1,545 | 223,177 | 2040/12/07 | |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30 | 国債証券 | | 4.7500 | 1,120 | 1,605 | 231,852 | 2030/12/07 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49 | 国債証券 | | 4.2500 | 990 | 1,802 | 260,337 | 2049/12/07 | |
| 小計 | — | — | — | 41,680 | 56,394 | 8,145,652 | — | |
| (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 4.5 11/15/39 | 国債証券 | | 4.5000 | 8,390 | 16,295 | 263,824 | 2039/11/15 | |
| DENMARK 1.75 11/15/25 | 国債証券 | | 1.7500 | 5,320 | 6,049 | 97,935 | 2025/11/15 | |
| DENMARK 1.5 11/15/23 | 国債証券 | | 1.5000 | 5,500 | 5,948 | 96,302 | 2023/11/15 | |
| DENMARK 0.5 11/15/27 | 国債証券 | | 0.5000 | 7,130 | 7,706 | 124,761 | 2027/11/15 | |
| 小計 | — | — | — | 26,340 | 35,998 | 582,823 | — | |
| (ノルウェー) | | | % | 千ノルウェー・クローネ | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | | |
| NORWAY 1.5 02/19/26 | 国債証券 | | 1.5000 | 3,770 | 3,809 | 45,824 | 2026/02/19 | |
| NORWAY 1.75 02/17/27 | 国債証券 | | 1.7500 | 3,970 | 4,079 | 49,074 | 2027/02/17 | |
| NORWAY 3.0 03/14/24 | 国債証券 | | 3.0000 | 6,200 | 6,611 | 79,537 | 2024/03/14 | |
| NORWAY 1.75 03/13/25 | 国債証券 | | 1.7500 | 3,800 | 3,880 | 46,678 | 2025/03/13 | |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国債証券 | | 2.0000 | 2,070 | 2,170 | 26,109 | 2028/04/26 | |
| 小計 | — | — | — | 19,810 | 20,550 | 247,224 | — | |
| (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 | 3,270 | 5,206 | 59,461 | 2039/03/30 | |
| SWEDEN 0.75 05/12/28 | 国債証券 | | 0.7500 | 3,740 | 4,035 | 46,082 | 2028/05/12 | |
| SWEDEN 2.5 05/12/25 | 国債証券 | | 2.5000 | 6,180 | 7,111 | 81,214 | 2025/05/12 | |
| SWEDEN 1.0 11/12/26 | 国債証券 | | 1.0000 | 4,250 | 4,623 | 52,795 | 2026/11/12 | |
| SWEDEN 0.75 11/12/29 | 国債証券 | | 0.7500 | 2,170 | 2,349 | 26,836 | 2029/11/12 | |
| 小計 | — | — | — | 19,610 | 23,326 | 266,391 | — | |
| (メキシコ) | | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | | |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26 | 国債証券 | | 5.7500 | 14,859 | 14,326 | 85,245 | 2026/03/05 | |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 | 国債証券 | | 8.5000 | 15,109 | 17,164 | 102,129 | 2029/05/31 | |
| MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31 | 国債証券 | | 7.7500 | 10,000 | 10,921 | 64,981 | 2031/05/29 | |

| 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 | |
| (メキシコ) | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 国債証券 | 7.5000 | 18,071 | 19,118 | 113,752 | 2027/06/03 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 国債証券 | 7.7500 | 14,643 | 16,258 | 96,736 | 2042/11/13 |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47 | 国債証券 | 8.0000 | 5,000 | 5,744 | 34,181 | 2047/11/07 |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38 | 国債証券 | 8.5000 | 11,125 | 13,202 | 78,554 | 2038/11/18 |
| MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36 | 国債証券 | 10.0000 | 8,085 | 10,775 | 64,116 | 2036/11/20 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34 | 国債証券 | 7.7500 | 7,000 | 7,732 | 46,010 | 2034/11/23 |
| MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 国債証券 | 10.0000 | 27,596 | 31,618 | 188,129 | 2024/12/05 |
| MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23 | 国債証券 | 8.0000 | 14,000 | 14,724 | 87,610 | 2023/12/07 |
| 小 計 | — | — | 145,488 | 161,587 | 961,447 | — |
| (マレーシア) | | % | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円 | |
| MALAYSIA 3.892 03/15/27 | 国債証券 | 3.8920 | 800 | 850 | 22,746 | 2027/03/15 |
| MALAYSIA 3.48 03/15/23 | 国債証券 | 3.4800 | 1,220 | 1,247 | 33,363 | 2023/03/15 |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26 | 国債証券 | 4.3920 | 3,070 | 3,323 | 88,891 | 2026/04/15 |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30 | 国債証券 | 4.4980 | 1,800 | 2,016 | 53,928 | 2030/04/15 |
| MALAYSIA 4.127 04/15/32 | 国債証券 | 4.1270 | 1,850 | 2,025 | 54,192 | 2032/04/15 |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 国債証券 | 3.8440 | 1,210 | 1,297 | 34,697 | 2033/04/15 |
| MALAYSIA 3.502 05/31/27 | 国債証券 | 3.5020 | 2,570 | 2,669 | 71,418 | 2027/05/31 |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28 | 国債証券 | 3.7330 | 2,000 | 2,111 | 56,472 | 2028/06/15 |
| MALAYSIA 4.16 07/15/21 | 国債証券 | 4.1600 | 4,000 | 4,073 | 108,964 | 2021/07/15 |
| MALAYSIA 4.181 07/15/24 | 国債証券 | 4.1810 | 2,430 | 2,569 | 68,728 | 2024/07/15 |
| MALAYSIA 3.418 08/15/22 | 国債証券 | 3.4180 | 3,000 | 3,050 | 81,596 | 2022/08/15 |
| MALAYSIA 5.248 09/15/28 | 国債証券 | 5.2480 | 1,600 | 1,871 | 50,056 | 2028/09/15 |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43 | 国債証券 | 4.9350 | 2,000 | 2,422 | 64,803 | 2043/09/30 |
| 小 計 | — | — | 27,550 | 29,527 | 789,861 | — |
| (南アフリカ) | | % | 千南アフリカ・ランド | 千南アフリカ・ランド | 千円 | |
| SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30 | 国債証券 | 8.0000 | 10,900 | 10,307 | 76,481 | 2030/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44 | 国債証券 | 8.7500 | 10,000 | 8,856 | 65,712 | 2044/01/31 |
| SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40 | 国債証券 | 9.0000 | 4,860 | 4,442 | 32,966 | 2040/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37 | 国債証券 | 8.5000 | 8,820 | 7,850 | 58,250 | 2037/01/31 |
| SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48 | 国債証券 | 8.7500 | 16,040 | 14,065 | 104,363 | 2048/02/28 |
| SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41 | 国債証券 | 6.5000 | 3,570 | 2,491 | 18,490 | 2041/02/28 |
| SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23 | 国債証券 | 7.7500 | 3,600 | 3,719 | 27,600 | 2023/02/28 |
| SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31 | 国債証券 | 7.0000 | 7,030 | 6,033 | 44,771 | 2031/02/28 |
| SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35 | 国債証券 | 8.8750 | 8,410 | 7,892 | 58,560 | 2035/02/28 |
| SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32 | 国債証券 | 8.2500 | 6,590 | 6,119 | 45,404 | 2032/03/31 |
| SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36 | 国債証券 | 6.2500 | 7,460 | 5,363 | 39,800 | 2036/03/31 |
| SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26 | 国債証券 | 10.5000 | 16,420 | 18,601 | 138,019 | 2026/12/21 |
| 小 計 | — | — | 103,700 | 95,743 | 710,419 | — |
| (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 | 1,350 | 1,384 | 39,139 | 2023/01/25 |
| POLAND 5.75 04/25/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,440 | 1,896 | 53,615 | 2029/04/25 |
| POLAND 2.75 04/25/28 | 国債証券 | 2.7500 | 1,900 | 1,990 | 56,265 | 2028/04/25 |
| POLAND 2.25 04/25/22 | 国債証券 | 2.2500 | 4,000 | 4,060 | 114,798 | 2022/04/25 |
| POLAND 2.5 04/25/24 | 国債証券 | 2.5000 | 2,290 | 2,361 | 66,765 | 2024/04/25 |
| POLAND 2.5 07/25/26 | 国債証券 | 2.5000 | 2,440 | 2,513 | 71,059 | 2026/07/25 |
| POLAND 3.25 07/25/25 | 国債証券 | 3.2500 | 2,380 | 2,547 | 72,005 | 2025/07/25 |
| POLAND 2.5 07/25/27 | 国債証券 | 2.5000 | 2,280 | 2,348 | 66,396 | 2027/07/25 |
| POLAND 5.75 09/23/22 | 国債証券 | 5.7500 | 1,720 | 1,900 | 53,732 | 2022/09/23 |

| 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 | |
| (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 4.0 10/25/23 | | 国債証券 | 4.0000 | 3,100 | 3,356 | 94,888 | 2023/10/25 |
| 小計 | | — | — | 22,900 | 24,360 | 688,666 | — |
| (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 | 540 | 735 | 88,985 | 2045/02/18 |
| IRISH 1.35 03/18/31 | | 国債証券 | 1.3500 | 210 | 242 | 29,371 | 2031/03/18 |
| IRISH 3.4 03/18/24 | | 国債証券 | 3.4000 | 510 | 591 | 71,487 | 2024/03/18 |
| IRISH 5.4 03/13/25 | | 国債証券 | 5.4000 | 800 | 1,037 | 125,413 | 2025/03/13 |
| IRISH 3.9 03/20/23 | | 国債証券 | 3.9000 | 240 | 272 | 32,992 | 2023/03/20 |
| IRISH 0.8 03/15/22 | | 国債証券 | 0.8000 | 370 | 380 | 45,966 | 2022/03/15 |
| IRISH 1.5 05/15/50 | | 国債証券 | 1.5000 | 270 | 336 | 40,687 | 2050/05/15 |
| IRISH 1.3 05/15/33 | | 国債証券 | 1.3000 | 260 | 302 | 36,586 | 2033/05/15 |
| IRISH 2.4 05/15/30 | | 国債証券 | 2.4000 | 690 | 868 | 105,056 | 2030/05/15 |
| IRISH 0.9 05/15/28 | | 国債証券 | 0.9000 | 580 | 634 | 76,699 | 2028/05/15 |
| IRISH 1.1 05/15/29 | | 国債証券 | 1.1000 | 340 | 380 | 45,955 | 2029/05/15 |
| IRISH 1.0 05/15/26 | | 国債証券 | 1.0000 | 680 | 736 | 89,057 | 2026/05/15 |
| IRISH 1.7 05/15/37 | | 国債証券 | 1.7000 | 320 | 397 | 48,104 | 2037/05/15 |
| IRISH 0.4 05/15/35 | | 国債証券 | 0.4000 | 220 | 225 | 27,266 | 2035/05/15 |
| IRISH 10/18/22 | | 国債証券 | 0.0000 | 220 | 223 | 26,976 | 2022/10/18 |
| 小計 | | — | — | 6,250 | 7,364 | 890,608 | — |
| (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 | 960 | 1,755 | 212,343 | 2042/01/15 |
| NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | | 国債証券 | 2.7500 | 900 | 1,553 | 187,844 | 2047/01/15 |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/23 | | 国債証券 | 3.7500 | 300 | 338 | 40,988 | 2023/01/15 |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28 | | 国債証券 | 5.5000 | 850 | 1,255 | 151,883 | 2028/01/15 |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37 | | 国債証券 | 4.0000 | 950 | 1,613 | 195,141 | 2037/01/15 |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33 | | 国債証券 | 2.5000 | 910 | 1,234 | 149,258 | 2033/01/15 |
| NETHERLANDS 0.5 01/15/40 | | 国債証券 | 0.5000 | 340 | 374 | 45,257 | 2040/01/15 |
| NETHERLANDS 01/15/22 | | 国債証券 | 0.0000 | 460 | 465 | 56,288 | 2022/01/15 |
| NETHERLANDS 01/15/24 | | 国債証券 | 0.0000 | 1,230 | 1,259 | 152,362 | 2024/01/15 |
| NETHERLANDS 3.25 07/15/21 | | 国債証券 | 3.2500 | 1,860 | 1,960 | 237,138 | 2021/07/15 |
| NETHERLANDS 1.75 07/15/23 | | 国債証券 | 1.7500 | 1,110 | 1,201 | 145,262 | 2023/07/15 |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/26 | | 国債証券 | 0.5000 | 940 | 1,001 | 121,097 | 2026/07/15 |
| NETHERLANDS 2.25 07/15/22 | | 国債証券 | 2.2500 | 880 | 941 | 113,864 | 2022/07/15 |
| NETHERLANDS 2.0 07/15/24 | | 国債証券 | 2.0000 | 820 | 914 | 110,641 | 2024/07/15 |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/25 | | 国債証券 | 0.2500 | 1,020 | 1,065 | 128,793 | 2025/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/28 | | 国債証券 | 0.7500 | 750 | 825 | 99,771 | 2028/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/27 | | 国債証券 | 0.7500 | 1,000 | 1,090 | 131,925 | 2027/07/15 |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/29 | | 国債証券 | 0.2500 | 790 | 835 | 101,042 | 2029/07/15 |
| 小計 | | — | — | 16,070 | 19,688 | 2,380,903 | — |
| (ユーロ…ベルギー) | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| BELGIUM 4.0 03/28/22 | | 国債証券 | 4.0000 | 1,080 | 1,185 | 143,365 | 2022/03/28 |
| BELGIUM 5.5 03/28/28 | | 国債証券 | 5.5000 | 1,240 | 1,832 | 221,578 | 2028/03/28 |
| BELGIUM 4.25 03/28/41 | | 国債証券 | 4.2500 | 1,070 | 1,921 | 232,388 | 2041/03/28 |
| BELGIUM 4.5 03/28/26 | | 国債証券 | 4.5000 | 790 | 1,031 | 124,724 | 2026/03/28 |
| BELGIUM 4.0 03/28/32 | | 国債証券 | 4.0000 | 530 | 792 | 95,865 | 2032/03/28 |
| BELGIUM 5.0 03/28/35 | | 国債証券 | 5.0000 | 1,210 | 2,100 | 254,045 | 2035/03/28 |
| BELGIUM 1.25 04/22/33 | | 国債証券 | 1.2500 | 510 | 594 | 71,901 | 2033/04/22 |
| BELGIUM 3.75 06/22/45 | | 国債証券 | 3.7500 | 630 | 1,131 | 136,882 | 2045/06/22 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|--------------------------|------|--------|--------|--------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ベルギー) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| BELGIUM 1.6 06/22/47 | 国債証券 | 1.6000 | 640 | 821 | 99,325 | 2047/06/22 |
| BELGIUM 1.7 06/22/50 | 国債証券 | 1.7000 | 390 | 513 | 62,072 | 2050/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/57 | 国債証券 | 2.2500 | 320 | 489 | 59,163 | 2057/06/22 |
| BELGIUM 2.15 06/22/66 | 国債証券 | 2.1500 | 320 | 495 | 59,882 | 2066/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/26 | 国債証券 | 1.0000 | 720 | 784 | 94,912 | 2026/06/22 |
| BELGIUM 2.6 06/22/24 | 国債証券 | 2.6000 | 1,050 | 1,194 | 144,444 | 2024/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/31 | 国債証券 | 1.0000 | 810 | 910 | 110,132 | 2031/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/23 | 国債証券 | 2.2500 | 160 | 175 | 21,199 | 2023/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/28 | 国債証券 | 0.8000 | 880 | 959 | 115,974 | 2028/06/22 |
| BELGIUM 0.9 06/22/29 | 国債証券 | 0.9000 | 610 | 674 | 81,571 | 2029/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/34 | 国債証券 | 3.0000 | 470 | 669 | 80,915 | 2034/06/22 |
| BELGIUM 1.9 06/22/38 | 国債証券 | 1.9000 | 590 | 763 | 92,374 | 2038/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/25 | 国債証券 | 0.8000 | 900 | 961 | 116,295 | 2025/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/27 | 国債証券 | 0.8000 | 650 | 704 | 85,255 | 2027/06/22 |
| BELGIUM 1.45 06/22/37 | 国債証券 | 1.4500 | 150 | 181 | 21,917 | 2037/06/22 |
| BELGIUM 0.1 06/22/30 | 国債証券 | 0.1000 | 240 | 245 | 29,737 | 2030/06/22 |
| BELGIUM 4.25 09/28/21 | 国債証券 | 4.2500 | 1,240 | 1,336 | 161,629 | 2021/09/28 |
| BELGIUM 4.25 09/28/22 | 国債証券 | 4.2500 | 1,190 | 1,341 | 162,252 | 2022/09/28 |
| BELGIUM 0.5 10/22/24 | 国債証券 | 0.5000 | 530 | 555 | 67,147 | 2024/10/22 |
| BELGIUM 0.2 10/22/23 | 国債証券 | 0.2000 | 660 | 678 | 82,072 | 2023/10/22 |
| 小計 | - | - | 19,580 | 25,047 | 3,029,029 | - |
| (ユーロ…フランス) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FRANCE OAT 03/25/24 | 国債証券 | 0.0000 | 2,720 | 2,785 | 336,795 | 2024/03/25 |
| FRANCE OAT 03/25/25 | 国債証券 | 0.0000 | 1,270 | 1,302 | 157,570 | 2025/03/25 |
| FRANCE OAT 03/25/23 | 国債証券 | 0.0000 | 1,900 | 1,936 | 234,128 | 2023/03/25 |
| FRANCE BTAN 8.5 04/25/23 | 国債証券 | 8.5000 | 1,030 | 1,332 | 161,114 | 2023/04/25 |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26 | 国債証券 | 3.5000 | 2,800 | 3,489 | 422,036 | 2026/04/25 |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41 | 国債証券 | 4.5000 | 2,270 | 4,233 | 511,908 | 2041/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55 | 国債証券 | 4.0000 | 960 | 1,994 | 241,217 | 2055/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60 | 国債証券 | 4.0000 | 790 | 1,732 | 209,548 | 2060/04/25 |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29 | 国債証券 | 5.5000 | 2,540 | 3,907 | 472,479 | 2029/04/25 |
| FRANCE OAT 3.0 04/25/22 | 国債証券 | 3.0000 | 2,850 | 3,076 | 372,075 | 2022/04/25 |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 国債証券 | 4.7500 | 1,650 | 2,823 | 341,495 | 2035/04/25 |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 国債証券 | 3.2500 | 1,640 | 2,751 | 332,771 | 2045/05/25 |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48 | 国債証券 | 2.0000 | 1,490 | 2,078 | 251,312 | 2048/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/50 | 国債証券 | 1.5000 | 1,560 | 1,973 | 238,667 | 2050/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 国債証券 | 1.7500 | 650 | 924 | 111,751 | 2066/05/25 |
| FRANCE OAT 2.25 05/25/24 | 国債証券 | 2.2500 | 1,980 | 2,221 | 268,616 | 2024/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 国債証券 | 2.5000 | 2,770 | 3,543 | 428,519 | 2030/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 2,610 | 2,844 | 344,009 | 2028/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31 | 国債証券 | 1.5000 | 2,290 | 2,712 | 328,057 | 2031/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25 | 国債証券 | 0.5000 | 2,620 | 2,762 | 334,053 | 2025/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/29 | 国債証券 | 0.5000 | 2,190 | 2,344 | 283,550 | 2029/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34 | 国債証券 | 1.2500 | 1,740 | 2,040 | 246,778 | 2034/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26 | 国債証券 | 0.5000 | 2,070 | 2,193 | 265,246 | 2026/05/25 |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27 | 国債証券 | 1.0000 | 1,650 | 1,817 | 219,783 | 2027/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/23 | 国債証券 | 1.7500 | 1,930 | 2,079 | 251,529 | 2023/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 国債証券 | 1.2500 | 1,990 | 2,340 | 283,029 | 2036/05/25 |

| 銘 | 柄 | 当 | | | | 期 | | 末 | | | | | | | | |
|----------------------------|---|---|---|---|---|--------|--------|---|---------|----|------------|---|---|------------|---|---|
| | | 種 | 類 | 利 | 率 | 額 | 面 | 金 | 額 | | 償 | 還 | 年 | 月 | 日 | |
| | | | | | | | | | 外 | 貨 | | | | | | 建 |
| (ユーロ…フランス) | | | | % | | 千 | ユー | ロ | 千 | ユー | ロ | 千 | 円 | | | |
| FRANCE OAT 05/25/22 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 3,000 | | 3,043 | | 368,002 | | | 2022/05/25 | | |
| FRANCE OAT 05/25/21 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 2,510 | | 2,528 | | 305,825 | | | 2021/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 1,280 | | 1,643 | | 198,741 | | | 2039/06/25 | | |
| FRANCE OAT 4.25 10/25/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500 | 3,500 | | 4,131 | | 499,630 | | | 2023/10/25 | | |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.0000 | 1,800 | | 2,472 | | 298,974 | | | 2025/10/25 | | |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.7500 | 2,700 | | 3,357 | | 406,048 | | | 2027/10/25 | | |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | 1,770 | | 3,003 | | 363,187 | | | 2038/10/25 | | |
| FRANCE OAT 3.25 10/25/21 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500 | 2,980 | | 3,174 | | 383,851 | | | 2021/10/25 | | |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.7500 | 2,120 | | 3,699 | | 447,366 | | | 2032/10/25 | | |
| FRANCE OAT 2.25 10/25/22 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.2500 | 3,030 | | 3,265 | | 394,870 | | | 2022/10/25 | | |
| FRANCE OAT 1.75 11/25/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 2,680 | | 2,976 | | 359,967 | | | 2024/11/25 | | |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000 | 1,720 | | 1,867 | | 225,874 | | | 2025/11/25 | | |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500 | 1,380 | | 1,442 | | 174,397 | | | 2026/11/25 | | |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.7500 | 2,140 | | 2,338 | | 282,736 | | | 2028/11/25 | | |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/29 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 610 | | 622 | | 75,322 | | | 2029/11/25 | | |
| 小 | 計 | - | | - | | | 83,180 | | 102,810 | | 12,432,844 | | | - | | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | % | | 千 | ユー | ロ | 千 | ユー | ロ | 千 | 円 | | | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.2500 | 840 | | 1,067 | | 129,067 | | | 2024/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.6250 | 1,100 | | 1,646 | | 199,120 | | | 2028/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.2500 | 710 | | 1,192 | | 144,230 | | | 2030/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 5.5000 | 1,240 | | 2,059 | | 249,010 | | | 2031/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.0000 | 1,500 | | 2,590 | | 313,214 | | | 2037/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | 1,650 | | 1,732 | | 209,565 | | | 2022/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 1,360 | | 1,439 | | 174,074 | | | 2025/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 1,260 | | 1,346 | | 162,775 | | | 2026/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500 | 1,670 | | 1,785 | | 215,972 | | | 2029/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 970 | | 1,033 | | 124,989 | | | 2023/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 1,430 | | 1,552 | | 187,720 | | | 2028/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 1,500 | | 1,646 | | 199,107 | | | 2024/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.2500 | 1,800 | | 1,907 | | 230,666 | | | 2027/02/15 | | |
| BUNDESOWL 04/08/22 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 1,340 | | 1,358 | | 164,301 | | | 2022/04/08 | | |
| BUNDESOWL 04/14/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 1,130 | | 1,153 | | 139,552 | | | 2023/04/14 | | |
| BUNDESOWL 04/05/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.0000 | 630 | | 647 | | 78,283 | | | 2024/04/05 | | |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 1,010 | | 1,103 | | 133,488 | | | 2024/05/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 850 | | 910 | | 110,091 | | | 2023/05/15 | | |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 6.5000 | 710 | | 1,085 | | 131,313 | | | 2027/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7500 | 600 | | 871 | | 105,369 | | | 2028/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.2500 | 840 | | 1,570 | | 189,868 | | | 2039/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500 | 900 | | 1,579 | | 191,063 | | | 2042/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | 1,660 | | 2,696 | | 326,082 | | | 2044/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7500 | 920 | | 1,852 | | 224,006 | | | 2040/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.2500 | 1,150 | | 1,211 | | 146,466 | | | 2021/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 1,540 | | 1,628 | | 196,902 | | | 2022/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 4.7500 | 1,370 | | 2,391 | | 289,210 | | | 2034/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.5000 | 1,730 | | 2,882 | | 348,631 | | | 2046/08/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 | 1,040 | | 1,401 | | 169,533 | | | 2048/08/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.0000 | 670 | | 731 | | 88,450 | | | 2025/08/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 | | 国 | 債 | 証 | 券 | 0.5000 | 1,600 | | 1,730 | | 209,317 | | | 2027/08/15 | | |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|---------------------------|------|--------|--------|--------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ドイツ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| DEUTSCHLAND 08/15/26 | 国債証券 | 0.0000 | 1,710 | 1,778 | 215,069 | 2026/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,440 | 1,536 | 185,855 | 2028/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 | 国債証券 | 2.0000 | 1,500 | 1,641 | 198,478 | 2023/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24 | 国債証券 | 1.0000 | 1,340 | 1,441 | 174,277 | 2024/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/29 | 国債証券 | 0.0000 | 430 | 449 | 54,383 | 2029/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50 | 国債証券 | 0.0000 | 330 | 324 | 39,275 | 2050/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21 | 国債証券 | 2.2500 | 1,070 | 1,117 | 135,138 | 2021/09/04 |
| DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22 | 国債証券 | 1.5000 | 1,650 | 1,741 | 210,627 | 2022/09/04 |
| BUNDESOWL 10/18/24 | 国債証券 | 0.0000 | 1,130 | 1,164 | 140,846 | 2024/10/18 |
| BUNDESOWL 10/07/22 | 国債証券 | 0.0000 | 1,400 | 1,424 | 172,246 | 2022/10/07 |
| BUNDESOWL 10/13/23 | 国債証券 | 0.0000 | 1,280 | 1,311 | 158,601 | 2023/10/13 |
| 小計 | - | - | 50,000 | 61,740 | 7,466,249 | - |
| (ユーロ…スペイン) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| SPAIN 5.85 01/31/22 | 国債証券 | 5.8500 | 1,810 | 2,032 | 245,755 | 2022/01/31 |
| SPAIN 6.0 01/31/29 | 国債証券 | 6.0000 | 1,580 | 2,406 | 291,001 | 2029/01/31 |
| SPAIN 4.8 01/31/24 | 国債証券 | 4.8000 | 1,130 | 1,357 | 164,175 | 2024/01/31 |
| SPAIN 4.2 01/31/37 | 国債証券 | 4.2000 | 1,340 | 2,118 | 256,163 | 2037/01/31 |
| SPAIN 5.4 01/31/23 | 国債証券 | 5.4000 | 1,460 | 1,709 | 206,752 | 2023/01/31 |
| SPAIN 1.6 04/30/25 | 国債証券 | 1.6000 | 1,660 | 1,815 | 219,536 | 2025/04/30 |
| SPAIN 3.8 04/30/24 | 国債証券 | 3.8000 | 1,270 | 1,487 | 179,929 | 2024/04/30 |
| SPAIN 1.5 04/30/27 | 国債証券 | 1.5000 | 1,210 | 1,340 | 162,157 | 2027/04/30 |
| SPAIN 1.95 04/30/26 | 国債証券 | 1.9500 | 1,530 | 1,724 | 208,525 | 2026/04/30 |
| SPAIN 1.4 04/30/28 | 国債証券 | 1.4000 | 1,240 | 1,375 | 166,283 | 2028/04/30 |
| SPAIN 1.45 04/30/29 | 国債証券 | 1.4500 | 1,370 | 1,532 | 185,326 | 2029/04/30 |
| SPAIN 0.4 04/30/22 | 国債証券 | 0.4000 | 1,570 | 1,599 | 193,380 | 2022/04/30 |
| SPAIN 0.5 04/30/30 | 国債証券 | 0.5000 | 850 | 873 | 105,609 | 2030/04/30 |
| SPAIN 5.9 07/30/26 | 国債証券 | 5.9000 | 1,170 | 1,620 | 195,948 | 2026/07/30 |
| SPAIN 4.9 07/30/40 | 国債証券 | 4.9000 | 1,170 | 2,084 | 252,032 | 2040/07/30 |
| SPAIN 4.7 07/30/41 | 国債証券 | 4.7000 | 1,070 | 1,891 | 228,758 | 2041/07/30 |
| SPAIN 3.45 07/30/66 | 国債証券 | 3.4500 | 760 | 1,330 | 160,940 | 2066/07/30 |
| SPAIN 4.65 07/30/25 | 国債証券 | 4.6500 | 1,370 | 1,729 | 209,141 | 2025/07/30 |
| SPAIN 1.95 07/30/30 | 国債証券 | 1.9500 | 1,650 | 1,941 | 234,775 | 2030/07/30 |
| SPAIN 5.75 07/30/32 | 国債証券 | 5.7500 | 1,220 | 2,027 | 245,212 | 2032/07/30 |
| SPAIN 2.35 07/30/33 | 国債証券 | 2.3500 | 1,140 | 1,422 | 172,021 | 2033/07/30 |
| SPAIN 1.4 07/30/28 | 国債証券 | 1.4000 | 1,540 | 1,703 | 206,047 | 2028/07/30 |
| SPAIN 1.85 07/30/35 | 国債証券 | 1.8500 | 490 | 582 | 70,479 | 2035/07/30 |
| SPAIN 0.75 07/30/21 | 国債証券 | 0.7500 | 1,700 | 1,730 | 209,274 | 2021/07/30 |
| SPAIN 0.25 07/30/24 | 国債証券 | 0.2500 | 340 | 347 | 42,051 | 2024/07/30 |
| SPAIN 0.35 07/30/23 | 国債証券 | 0.3500 | 1,120 | 1,146 | 138,689 | 2023/07/30 |
| SPAIN 2.75 10/31/24 | 国債証券 | 2.7500 | 1,540 | 1,757 | 212,542 | 2024/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/28 | 国債証券 | 5.1500 | 880 | 1,259 | 152,348 | 2028/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/44 | 国債証券 | 5.1500 | 830 | 1,610 | 194,782 | 2044/10/31 |
| SPAIN 2.9 10/31/46 | 国債証券 | 2.9000 | 1,040 | 1,506 | 182,234 | 2046/10/31 |
| SPAIN 2.7 10/31/48 | 国債証券 | 2.7000 | 860 | 1,215 | 146,998 | 2048/10/31 |
| SPAIN 2.15 10/31/25 | 国債証券 | 2.1500 | 1,580 | 1,786 | 216,081 | 2025/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/27 | 国債証券 | 1.4500 | 1,480 | 1,641 | 198,521 | 2027/10/31 |
| SPAIN 1.3 10/31/26 | 国債証券 | 1.3000 | 1,070 | 1,167 | 141,229 | 2026/10/31 |
| SPAIN 0.6 10/31/29 | 国債証券 | 0.6000 | 1,080 | 1,123 | 135,865 | 2029/10/31 |

| 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…スペイン) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| SPAIN 4.4 10/31/23 | 国債証券 | 4.4000 | 1,430 | 1,679 | 203,140 | 2023/10/31 |
| SPAIN 0.45 10/31/22 | 国債証券 | 0.4500 | 1,340 | 1,371 | 165,872 | 2022/10/31 |
| 小 計 | — | — | 45,890 | 57,054 | 6,899,589 | — |
| (ユーロ…イタリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 1,280 | 1,978 | 239,244 | 2033/02/01 |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37 | 国債証券 | 4.0000 | 970 | 1,338 | 161,865 | 2037/02/01 |
| ITALY BTPS 2.0 02/01/28 | 国債証券 | 2.0000 | 1,390 | 1,532 | 185,297 | 2028/02/01 |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47 | 国債証券 | 2.7000 | 1,020 | 1,211 | 146,562 | 2047/03/01 |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 国債証券 | 3.4500 | 1,020 | 1,377 | 166,608 | 2048/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/24 | 国債証券 | 4.5000 | 1,090 | 1,280 | 154,875 | 2024/03/01 |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67 | 国債証券 | 2.8000 | 660 | 794 | 96,095 | 2067/03/01 |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/25 | 国債証券 | 5.0000 | 1,790 | 2,209 | 267,250 | 2025/03/01 |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/22 | 国債証券 | 5.0000 | 1,700 | 1,877 | 227,105 | 2022/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26 | 国債証券 | 4.5000 | 1,630 | 2,023 | 244,660 | 2026/03/01 |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 国債証券 | 1.6500 | 640 | 681 | 82,416 | 2032/03/01 |
| ITALY BTPS 3.1 03/01/40 | 国債証券 | 3.1000 | 520 | 649 | 78,546 | 2040/03/01 |
| ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 国債証券 | 3.3500 | 970 | 1,233 | 149,193 | 2035/03/01 |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30 | 国債証券 | 3.5000 | 1,640 | 2,047 | 247,556 | 2030/03/01 |
| ITALY BTPS 0.95 03/15/23 | 国債証券 | 0.9500 | 1,070 | 1,101 | 133,160 | 2023/03/15 |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/23 | 国債証券 | 0.9500 | 920 | 946 | 114,448 | 2023/03/01 |
| ITALY BTPS 1.35 04/15/22 | 国債証券 | 1.3500 | 1,660 | 1,712 | 207,105 | 2022/04/15 |
| ITALY BTPS 1.2 04/01/22 | 国債証券 | 1.2000 | 770 | 792 | 95,779 | 2022/04/01 |
| ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 国債証券 | 1.3500 | 1,040 | 1,084 | 131,121 | 2030/04/01 |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31 | 国債証券 | 6.0000 | 2,000 | 3,050 | 368,909 | 2031/05/01 |
| ITALY BTPS 4.5 05/01/23 | 国債証券 | 4.5000 | 1,400 | 1,599 | 193,423 | 2023/05/01 |
| ITALY BTPS 3.75 05/01/21 | 国債証券 | 3.7500 | 2,300 | 2,409 | 291,434 | 2021/05/01 |
| ITALY BTPS 1.85 05/15/24 | 国債証券 | 1.8500 | 1,610 | 1,723 | 208,462 | 2024/05/15 |
| ITALY BTPS 1.45 05/15/25 | 国債証券 | 1.4500 | 1,540 | 1,629 | 197,066 | 2025/05/15 |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26 | 国債証券 | 1.6000 | 1,500 | 1,606 | 194,274 | 2026/06/01 |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25 | 国債証券 | 1.5000 | 1,690 | 1,793 | 216,838 | 2025/06/01 |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27 | 国債証券 | 2.2000 | 520 | 578 | 69,976 | 2027/06/01 |
| ITALY BTPS 0.45 06/01/21 | 国債証券 | 0.4500 | 910 | 918 | 111,049 | 2021/06/01 |
| ITALY BTPS 2.1 07/15/26 | 国債証券 | 2.1000 | 130 | 143 | 17,312 | 2026/07/15 |
| ITALY BTPS 3.75 08/01/21 | 国債証券 | 3.7500 | 3,200 | 3,383 | 409,145 | 2021/08/01 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34 | 国債証券 | 5.0000 | 1,610 | 2,397 | 289,923 | 2034/08/01 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39 | 国債証券 | 5.0000 | 1,330 | 2,091 | 252,883 | 2039/08/01 |
| ITALY BTPS 4.75 08/01/23 | 国債証券 | 4.7500 | 1,900 | 2,207 | 266,897 | 2023/08/01 |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国債証券 | 2.0500 | 1,600 | 1,764 | 213,360 | 2027/08/01 |
| ITALY BTPS 3.0 08/01/29 | 国債証券 | 3.0000 | 780 | 932 | 112,826 | 2029/08/01 |
| ITALY BTPS 0.9 08/01/22 | 国債証券 | 0.9000 | 980 | 1,004 | 121,450 | 2022/08/01 |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 国債証券 | 2.9500 | 940 | 1,146 | 138,591 | 2038/09/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国債証券 | 4.7500 | 970 | 1,540 | 186,262 | 2044/09/01 |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国債証券 | 3.2500 | 990 | 1,288 | 155,851 | 2046/09/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国債証券 | 4.7500 | 750 | 998 | 120,709 | 2028/09/01 |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40 | 国債証券 | 5.0000 | 1,440 | 2,274 | 275,070 | 2040/09/01 |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 国債証券 | 2.4500 | 700 | 786 | 95,096 | 2050/09/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/21 | 国債証券 | 4.7500 | 2,470 | 2,657 | 321,427 | 2021/09/01 |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国債証券 | 2.4500 | 1,100 | 1,269 | 153,514 | 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 3.75 09/01/24 | 国債証券 | 3.7500 | 1,900 | 2,201 | 266,175 | 2024/09/01 | |
| ITALY BTPS 3.85 09/01/49 | 国債証券 | 3.8500 | 740 | 1,066 | 128,979 | 2049/09/01 | |
| ITALY BTPS 5.5 09/01/22 | 国債証券 | 5.5000 | 1,150 | 1,311 | 158,652 | 2022/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 1,020 | 1,147 | 138,767 | 2036/09/01 | |
| ITALY BTPS 1.45 09/15/22 | 国債証券 | 1.4500 | 1,500 | 1,559 | 188,540 | 2022/09/15 | |
| ITALY BTPS 0.65 10/15/23 | 国債証券 | 0.6500 | 980 | 1,001 | 121,096 | 2023/10/15 | |
| ITALY BTPS 9.0 11/01/23 | 国債証券 | 9.0000 | 1,190 | 1,580 | 191,151 | 2023/11/01 | |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 国債証券 | 7.2500 | 1,080 | 1,556 | 188,214 | 2026/11/01 | |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27 | 国債証券 | 6.5000 | 1,790 | 2,568 | 310,648 | 2027/11/01 | |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 国債証券 | 5.2500 | 2,030 | 2,854 | 345,155 | 2029/11/01 | |
| ITALY BTPS 5.5 11/01/22 | 国債証券 | 5.5000 | 1,960 | 2,253 | 272,494 | 2022/11/01 | |
| ITALY BTPS 1.45 11/15/24 | 国債証券 | 1.4500 | 1,040 | 1,099 | 132,941 | 2024/11/15 | |
| ITALY BTPS 2.5 11/15/25 | 国債証券 | 2.5000 | 550 | 615 | 74,385 | 2025/11/15 | |
| ITALY BTPS 0.35 11/01/21 | 国債証券 | 0.3500 | 1,700 | 1,716 | 207,544 | 2021/11/01 | |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25 | 国債証券 | 2.0000 | 970 | 1,058 | 128,015 | 2025/12/01 | |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 国債証券 | 1.2500 | 1,350 | 1,415 | 171,157 | 2026/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/24 | 国債証券 | 2.5000 | 970 | 1,073 | 129,785 | 2024/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28 | 国債証券 | 2.8000 | 1,400 | 1,640 | 198,340 | 2028/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.15 12/15/21 | 国債証券 | 2.1500 | 1,680 | 1,751 | 211,796 | 2021/12/15 | |
| 小 計 | — | — | 81,140 | 96,539 | 11,674,496 | — | |
| (ユーロ…フィンランド) | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FINLAND 2.0 04/15/24 | 国債証券 | 2.0000 | 280 | 310 | 37,537 | 2024/04/15 | |
| FINLAND 0.75 04/15/31 | 国債証券 | 0.7500 | 380 | 419 | 50,722 | 2031/04/15 | |
| FINLAND 1.375 04/15/47 | 国債証券 | 1.3750 | 130 | 169 | 20,476 | 2047/04/15 | |
| FINLAND 0.5 04/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 300 | 317 | 38,438 | 2026/04/15 | |
| FINLAND 1.125 04/15/34 | 国債証券 | 1.1250 | 230 | 267 | 32,369 | 2034/04/15 | |
| FINLAND 1.5 04/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 170 | 181 | 21,932 | 2023/04/15 | |
| FINLAND 04/15/22 | 国債証券 | 0.0000 | 320 | 324 | 39,228 | 2022/04/15 | |
| FINLAND 4.0 07/04/25 | 国債証券 | 4.0000 | 430 | 536 | 64,824 | 2025/07/04 | |
| FINLAND 2.75 07/04/28 | 国債証券 | 2.7500 | 380 | 479 | 58,015 | 2028/07/04 | |
| FINLAND 2.625 07/04/42 | 国債証券 | 2.6250 | 350 | 541 | 65,528 | 2042/07/04 | |
| FINLAND 0.5 09/15/29 | 国債証券 | 0.5000 | 270 | 289 | 35,043 | 2029/09/15 | |
| FINLAND 0.875 09/15/25 | 国債証券 | 0.8750 | 300 | 323 | 39,082 | 2025/09/15 | |
| FINLAND 0.5 09/15/28 | 国債証券 | 0.5000 | 240 | 257 | 31,089 | 2028/09/15 | |
| FINLAND 0.5 09/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 300 | 320 | 38,704 | 2027/09/15 | |
| FINLAND 1.625 09/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 400 | 423 | 51,178 | 2022/09/15 | |
| FINLAND 09/15/23 | 国債証券 | 0.0000 | 230 | 235 | 28,422 | 2023/09/15 | |
| 小 計 | — | — | 4,710 | 5,396 | 652,595 | — | |
| (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 | 250 | 571 | 69,171 | 2062/01/26 | |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47 | 国債証券 | 1.5000 | 370 | 485 | 58,758 | 2047/02/20 | |
| AUSTRIA 0.5 02/20/29 | 国債証券 | 0.5000 | 340 | 364 | 44,050 | 2029/02/20 | |
| AUSTRIA 0.75 02/20/28 | 国債証券 | 0.7500 | 820 | 892 | 107,980 | 2028/02/20 | |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26 | 国債証券 | 4.8500 | 590 | 782 | 94,684 | 2026/03/15 | |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37 | 国債証券 | 4.1500 | 890 | 1,509 | 182,536 | 2037/03/15 | |
| AUSTRIA 3.65 04/20/22 | 国債証券 | 3.6500 | 280 | 305 | 36,999 | 2022/04/20 | |
| AUSTRIA 0.5 04/20/27 | 国債証券 | 0.5000 | 520 | 553 | 66,980 | 2027/04/20 | |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34 | 国債証券 | 2.4000 | 480 | 645 | 78,117 | 2034/05/23 | |

| 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 3.15 06/20/44 | 国債証券 | 3.1500 | 460 | 781 | 94,447 | 2044/06/20 |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 国債証券 | 6.2500 | 670 | 1,004 | 121,476 | 2027/07/15 |
| AUSTRIA 07/15/23 | 国債証券 | 0.0000 | 350 | 357 | 43,178 | 2023/07/15 |
| AUSTRIA 3.5 09/15/21 | 国債証券 | 3.5000 | 1,420 | 1,511 | 182,745 | 2021/09/15 |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17 | 国債証券 | 2.1000 | 330 | 643 | 77,778 | 2117/09/20 |
| AUSTRIA 09/20/22 | 国債証券 | 0.0000 | 470 | 477 | 57,767 | 2022/09/20 |
| AUSTRIA 1.65 10/21/24 | 国債証券 | 1.6500 | 540 | 596 | 72,076 | 2024/10/21 |
| AUSTRIA 0.75 10/20/26 | 国債証券 | 0.7500 | 580 | 625 | 75,686 | 2026/10/20 |
| AUSTRIA 1.2 10/20/25 | 国債証券 | 1.2000 | 640 | 701 | 84,885 | 2025/10/20 |
| AUSTRIA 1.75 10/20/23 | 国債証券 | 1.7500 | 750 | 815 | 98,569 | 2023/10/20 |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86 | 国債証券 | 1.5000 | 180 | 262 | 31,776 | 2086/11/02 |
| AUSTRIA 3.4 11/22/22 | 国債証券 | 3.4000 | 740 | 822 | 99,484 | 2022/11/22 |
| 小 計 | — | — | 11,670 | 14,712 | 1,779,149 | — |
| 合 計 | — | — | — | — | 127,972,430 | — |

■投資信託財産の構成

2020年2月21日現在

| 項 目 | 当 期 | 末 |
|-------------------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 127,972,430 | % 97.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 3,017,425 | 2.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 130,989,855 | 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、130,489,048千円、99.6%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、2020年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.11円、1カナダ・ドル=84.60円、1オーストラリア・ドル=74.21円、1シンガポール・ドル=80.07円、1イギリス・ポンド=144.44円、1デンマーク・クローネ=16.19円、1ノルウェー・クローネ=12.03円、1スウェーデン・クローナ=11.42円、1メキシコ・ペソ=5.95円、1マレーシア・リンギット=26.75円、1南アフリカ・ランド=7.42円、1ポーランド・ズロチ=28.27円、1ユーロ=120.93円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月21日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 130,989,855,521円 |
| コ ー ル ・ ク ー ン 等 | 2,138,894,536 |
| 公 社 債(評価額) | 127,972,430,109 |
| 未 収 利 息 | 869,632,019 |
| 前 払 費 用 | 8,898,857 |
| (B) 負 債 | 185,938,200 |
| 未 払 解 約 金 | 185,938,200 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 130,803,917,321 |
| 元 本 | 66,784,593,799 |
| 次 期 繰 越 損 益 | 64,019,323,522 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 66,784,593,799口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 19,586円 |

| | |
|---------------------------------|------------------|
| (注1) 期首元本額 | 108,789,722,301円 |
| 追加設定元本額 | 14,409,786,591円 |
| 一部解約元本額 | 56,414,915,093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 | 8,874,003,827円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 5,775,654円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 22,123,281円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 25,741,467円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 80,085,833円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 83,655,608円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 35,465,308円 |
| たわらノーロード 先進国債券 | 6,509,607,053円 |
| たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け> | 149,495,926円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 479,712,374円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 11,707,903円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 55,613,057円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 11,564,861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) | 1,913,072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) | 134,211,407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) | 176,522,766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) | 60,240,852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) | 36,378,986円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 68,332円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 2,616,898円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 4,040,132円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 1,282,053円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 2,349,638円 |
| D I A M 外国債券インデックスファンド<DC年金> | 5,832,006,477円 |
| One DC 先進国債券インデックスファンド | 639,979円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型 | 585,714,796円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型 | 1,821,374,172円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型 | 1,899,253,523円 |
| D I A M DC バランス30インデックスファンド | 367,533,477円 |
| D I A M DC バランス50インデックスファンド | 797,283,999円 |
| D I A M DC バランス70インデックスファンド | 632,041,626円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 20,946,445円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 607,750,277円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 22,230,425円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 125,271,635円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 89,691,387円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 147,541,325円 |
| クルーズコントロール | 1,255,331,264円 |

| | |
|--|-----------------|
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> | 109,167,362円 |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> | 177,161,233円 |
| クルーズコントロール<DC年金> | 1,269,534円 |
| D I A M コア資産設計ファンド (堅実型) | 1,786,439円 |
| D I A M コア資産設計ファンド (積極型) | 7,504,090円 |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 38,912,796円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 120,359,994円 |
| 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> | 139,662円 |
| D I A M パッシブ資産分散ファンド | 1,165,889,077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) | 818,056円 |
| D I A M 指替フルヘルプ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) | 6,588,503,236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) | 3,322,079,347円 |
| 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) | 2,199,859,662円 |
| 先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) | 6,073,392,201円 |
| D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) | 71,552,724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) | 255,255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) | 606,183,336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) | 455,700,977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) | 42,453,454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) | 68,261,200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) | 19,577,030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) | 5,136,190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) | 55,431,781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) | 76,799,804円 |
| D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 2,762,682,039円 |
| D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) | 1,924,647,331円 |
| D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 3,376,447,915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) | 604,894,639円 |
| D I A M グローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) | 234,213,008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) | 2,604,999,197円 |
| D I A M 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家向け) | 639,500,550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) | 4,781,172円 |
| D I A M 世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定) | 91,625,774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) | 449,766,733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) | 644,060,493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) | 1,151,182,638円 |
| D I A M 世界バランス25VA (適格機関投資家限定) | 73,750,748円 |
| D I A M バランス20VA (適格機関投資家限定) | 44,525,537円 |
| D I A M バランス40VA (適格機関投資家限定) | 364,076円 |
| D I A M バランス60VA (適格機関投資家限定) | 170,414円 |
| 期末元本合計 | 66,784,593,799円 |

■損益の状況

当期 自2019年2月22日 至2020年2月21日

| 項 | 目 | 当 期 |
|--------------------------|---|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | | 3,956,180,646円 |
| 受 取 利 息 | | 3,956,709,728 |
| 支 払 利 息 | | △529,082 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | | 7,416,281,605 |
| 売 買 益 | | 12,399,227,471 |
| 売 買 損 | | △4,982,945,866 |
| (C) そ の 他 費 用 | | △19,454,538 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | | 11,353,007,713 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | | 88,880,284,980 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | | △48,712,391,980 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | | 12,498,422,809 |
| (H) 合 計(D + E + F + G) | | 64,019,323,522 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | | 64,019,323,522 |

(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。