

運用報告書（全体版）

第3期＜決算日2022年3月25日＞

One DC 先進国債券インデックスファンド

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	2019年6月28日から無期限です。	
運用方針	F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を図ることを目的として、運用を行います。	
主要投資対象	One DC 先進国債券インデックスファンド	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	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。実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
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%未満とします。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（毎年3月25日。休業日の場合は翌営業日。）に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。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、「One DC 先進国債券インデックスファンド」は、2022年3月25日に第3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/>

One DC 先進国債券インデックスファンド

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			F T S E 世界国債インデックス (除く日本、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 騰 落 中 率	ポ ン 点 (6月27日)	期 騰 落 中 率			
(設 定 日) 2019年6月28日	円 10,000	円 —	% —	115,499.03	% —	% —	% —	百万円 1
1 期 (2020年3月25日)	10,516	0	5.2	121,384.25	5.1	96.2	—	1
2 期 (2021年3月25日)	10,835	0	3.0	125,741.30	3.6	98.4	—	591
3 期 (2022年3月25日)	11,125	0	2.7	129,209.02	2.8	98.8	—	1,197

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

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

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) ベンチマークは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) 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5) F T S E 世界国債インデックスは、F T S E F i x e d I n c o m e L L Cにより運営されている債券インデックスです。F T S E F i x e d I n c o m e L L C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、F T S E F i x e d I n c o m e L L C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F T S E F i x e d I n c o m e L L Cに帰属します (以下同じ)。

(注6) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	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 率	債券先物 率
			騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 3 月 25 日	円 10,835	% —	ポイント 125,741.30	% —	% 98.4	% —
3 月 末	10,920	0.8	126,595.03	0.7	95.3	—
4 月 末	10,915	0.7	126,569.17	0.7	97.6	—
5 月 末	11,060	2.1	128,227.80	2.0	98.9	—
6 月 末	11,040	1.9	128,117.08	1.9	97.7	—
7 月 末	11,115	2.6	128,989.36	2.6	98.8	—
8 月 末	11,111	2.5	128,937.19	2.5	98.7	—
9 月 末	11,034	1.8	128,115.00	1.9	98.8	—
10 月 末	11,270	4.0	130,788.36	4.0	98.8	—
11 月 末	11,143	2.8	129,217.14	2.8	98.6	—
12 月 末	11,211	3.5	130,157.13	3.5	99.3	—
2022 年 1 月 末	11,017	1.7	128,015.91	1.8	99.0	—
2 月 末	10,818	△0.2	125,907.80	0.1	98.8	—
(期 末) 2022 年 3 月 25 日	11,125	2.7	129,209.02	2.8	98.8	—

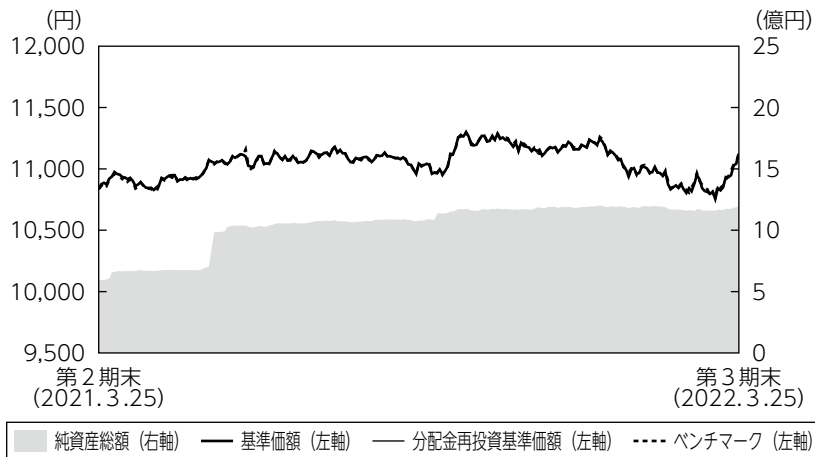
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2021年3月26日から2022年3月25日まで）

基準価額等の推移



第3期首：10,835円
第3期末：11,125円
(既払分配金0円)
騰落率：2.7%
(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

ロシアのウクライナへの侵攻を受けた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）しましたが、債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことが大きく寄与したことから基準価額は上昇しました。米ドル／円相場はF R B（米連邦準備理事会）による利上げやバランスシートの規模縮小を受けて、米国債の利回り上昇から円安米ドル高になりました。ユーロ／円相場においても円安に動いたことから基準価額は上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りはともに上昇しました。米国債は、インフレ懸念の高まりやF R Bによる利上げ、バランスシートの規模縮小が示された他、ロシアのウクライナへの侵攻を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についてもロシアのウクライナへの侵攻を受けて利回りは上昇しました。

為替市場では米ドル／円相場は円安米ドル高、ユーロ／円相場は円安ユーロ高となりました。米ドル／円相場は、インフレ懸念の高まりやF R Bによる利上げ、バランスシートの規模縮小を受けて、米国債の利回り上昇から円安米ドル高に推移しました。ユーロ／円相場についても、ロシアのウクライナへの侵攻を受けて、ドイツ債の利回り上昇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

当ファンドの主要投資対象は外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドであり、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

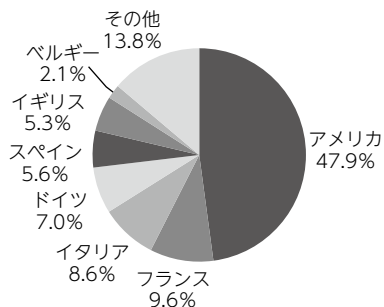
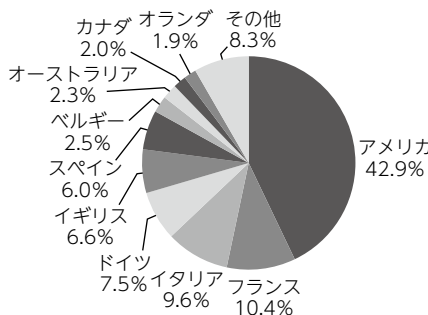
ベンチマークであるF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○国別配分

期首（前期末）

期末



（注1）比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

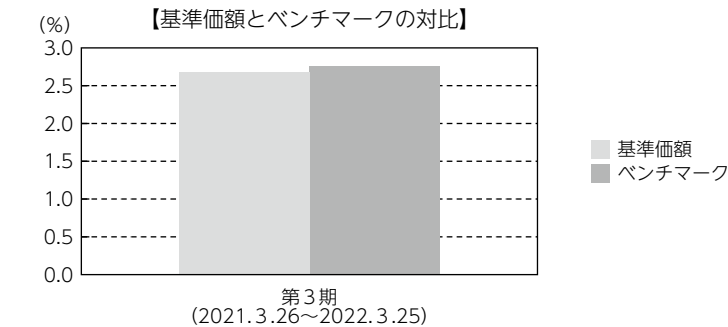
（注2）現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

（注3）期首（前期末）は上位11位以下、期末は上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

（注4）発行国（地域）を表示しています。

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2.8%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%と、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。なお、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、信託報酬等の影響が挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。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
	2021年3月26日 ～2022年3月25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	1,124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

当ファンドの運用方針については、引き続き外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。今後も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

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3期		項目の概要
	(2021年3月26日 ～2022年3月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	17円	0.154%	(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11,050円です。
（投信会社）	（ 7）	(0.066)	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）	（ 7）	(0.066)	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）	（ 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）	(0.012)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
（監査費用）	（ 0）	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
（その他）	（ 0）	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	19	0.171	

(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。

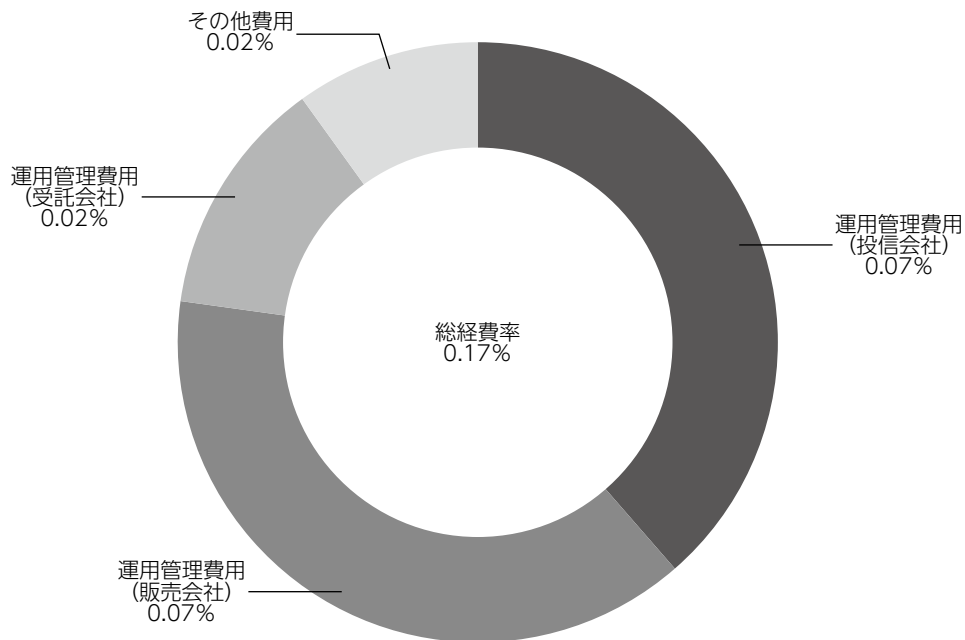
(注 2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.17%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（2021年3月26日から2022年3月25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 339,003	千円 693,179	千口 53,609	千円 109,441

■利害関係人との取引状況等（2021年3月26日から2022年3月25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。

■自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高 (元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高 (元本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 －	百万円 1	百万円 －	当初設定時又は当初運用時における取得の処分

■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 295,114	千口 580,508	千円 1,197,182

■投資信託財産の構成

2022年 3月25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	1,197,182	99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,244	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	1,198,427	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。
(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2022年 3月25日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは171,542,751千円、99.4%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、2022年 3月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=122.07円、1カナダ・ドル=97.31円、1オーストラリア・ドル=91.61円、1シンガポール・ドル=89.96円、1イギリス・ポンド=160.94円、1イスラエル・シェケル=37.94円、1デンマーク・クローネ=18.06円、1ノルウェー・クローネ=14.08円、1スウェーデン・クローナ=12.99円、1メキシコ・ペソ=6.078円、1オフショア・人民元=19.13円、1マレーシア・リンギット=28.905円、1ポーランド・ズロチ=28.148円、1ユーロ=134.35円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年 3月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,198,427,351円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,244,895
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,197,182,456
(B) 負 債	1,189,606
未 払 解 約 金	283,554
未 払 信 託 報 酬	885,331
そ の 他 未 払 費 用	20,721
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,197,237,745
元 本	1,076,203,012
次 期 繰 越 損 益 金	121,034,733
(D) 受 益 権 総 口 数	1,076,203,012口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,125円

(注) 期首における元本額は546,249,010円、当期中における追加設定元本額は725,644,436円、同解約元本額は195,690,434円です。

■損益の状況

当期 自2021年 3月26日 至2022年 3月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△122円
受 取 利 息	10
支 払 利 息	△132
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	19,480,397
売 買 益 損	22,244,785
買 買 損 益	△2,764,388
(C) 信 託 報 酬 等	△1,641,728
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	17,838,547
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	6,010,479
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	97,185,707
(配 当 等 相 当 額)	(47,496,064)
(売 買 損 益 相 当 額)	(49,689,643)
(G) 合 計(D+E+F)	121,034,733
次 期 繰 越 損 益 金(G)	121,034,733
追 加 信 託 差 損 益 金	97,185,707
(配 当 等 相 当 額)	(48,024,995)
(売 買 損 益 相 当 額)	(49,160,712)
分 配 準 備 積 立 金	23,849,026

(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	17,485,046円
(b) 経 費 控 除 後 の 有 価 証 券 売 買 等 損 益	353,501
(c) 収 益 調 整 金	97,185,707
(d) 分 配 準 備 積 立 金	6,010,479
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	121,034,733
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,124.65
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、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19期（決算日 2022年2月21日）

（計算期間 2021年2月23日～2022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19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年12月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、「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）」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		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)		債券組入率	債券先物率	純 資 産 額
	円	期 中 騰 落 率	ポ ン ト	期 中 騰 落 率			
15期 (2018年2月21日)	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	—	百万円 217,863
16期 (2019年2月21日)	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	—	197,670
17期 (2020年2月21日)	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	—	130,803
18期 (2021年2月22日)	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	—	137,037
19期 (2022年2月21日)	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	—	141,964

(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）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) F T S E 世界国債インデックスは、F T S E F i x e d I n c o m e L L Cにより運営されている債券インデックスです。F T S E F i x e d I n c o m e L L C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、F T S E F i x e d I n c o m e L L C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F T S E F i x e d I n c o m e L L C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）。

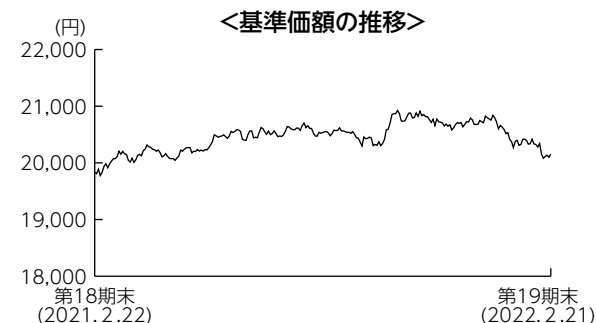
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2021 年 2 月 22 日	円 19,836	% —	ポイント 124,229.95	% —	% 98.4	% —
2 月 末	19,776	△0.3	124,359.44	0.1	99.0	—
3 月 末	20,213	1.9	126,595.03	1.9	95.3	—
4 月 末	20,206	1.9	126,569.17	1.9	97.6	—
5 月 末	20,477	3.2	128,227.80	3.2	98.9	—
6 月 末	20,443	3.1	128,117.08	3.1	97.7	—
7 月 末	20,584	3.8	128,989.36	3.8	98.8	—
8 月 末	20,579	3.7	128,937.19	3.8	98.7	—
9 月 末	20,439	3.0	128,115.00	3.1	98.8	—
10 月 末	20,879	5.3	130,788.36	5.3	98.8	—
11 月 末	20,647	4.1	129,217.14	4.0	98.6	—
12 月 末	20,775	4.7	130,157.13	4.8	99.3	—
2022 年 1 月 末	20,418	2.9	128,015.91	3.0	99.0	—
(期 末) 2022 年 2 月 21 日	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

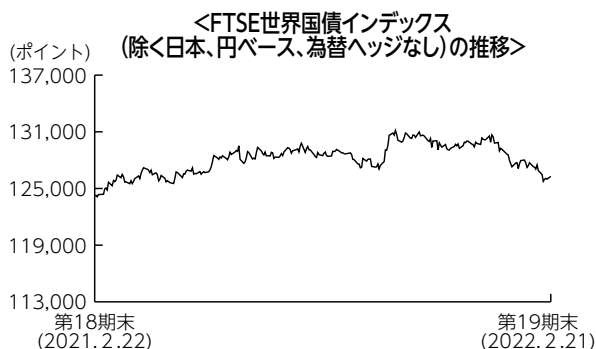


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,152円となり、前期末比で1.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

F O M C（米連邦公開市場委員会）による2022年複数回の利上げ示唆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F O M Cによる早期テーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）や2022年複数回の利上げとの見方から円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことから基準価額は上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、新型コロナウイルスのオミクロン株の重症化リスクが高くない可能性があるという報告やインフレ懸念、F O M Cの早期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E C B（欧州中央銀行）がパンデ

ミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等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、F O M Cの早期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円安ドル高が進みました。ユーロ／円は、E C Bがパンデミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

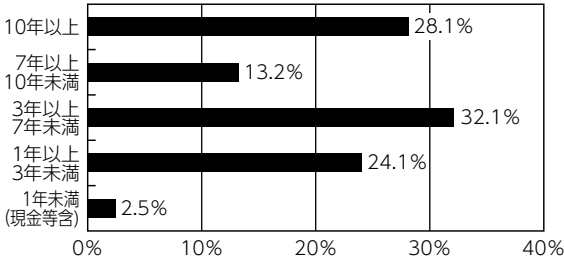
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

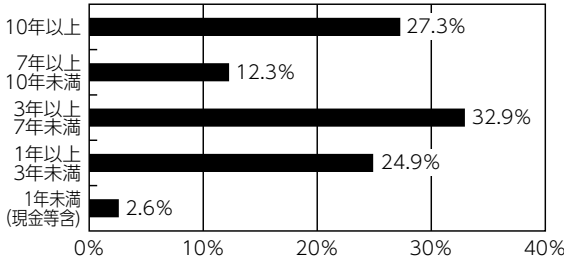
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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	42.4%	43.3%	△0.9%
	カナダ	2.0%	2.0%	0.0%
	計	44.3%	45.2%	△0.9%
中南米	メキシコ	0.8%	0.8%	0.0%
	計	0.8%	0.8%	0.0%
欧州	オーストリア	1.5%	1.6%	△0.1%
	ベルギー	2.5%	2.6%	△0.1%
	フィンランド	0.6%	0.7%	0.0%
	フランス	10.6%	10.7%	△0.2%
	ドイツ	7.5%	7.7%	△0.2%
	アイルランド	0.8%	0.9%	0.0%
	イタリア	9.5%	9.8%	△0.3%
	オランダ	1.8%	1.9%	△0.1%
	スペイン	6.1%	6.1%	0.0%
	ユーロ計	40.9%	41.9%	△1.0%
	デンマーク	0.5%	0.5%	0.0%
	スウェーデン	0.3%	0.3%	0.0%
	英国	6.6%	6.6%	0.0%
アジア・オセアニア	オーストラリア	2.8%	2.3%	0.5%
	シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
	マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
	計	3.6%	3.2%	0.4%
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		1.6%	—	—
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	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%
アジア・オセアニア	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%
	オーストラリア	1.5%	1.6%	△0.0%
	中国	0.9%	1.2%	△0.3%
中近東	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%
	イスラエル	0.4%	0.4%	△0.0%
現金など		1.1%	—	—
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1.7%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%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	3円	0.013%	(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)	(2)	(0.012)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(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	3	0.013	
期中の平均基準価額は20,455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 (2021年2月23日から2022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 268,986	千アメリカ・ドル 208,086
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 12,930	千カナダ・ドル 11,930
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 9,151	千オーストラリア・ドル 25,829
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,943	千シンガポール・ドル 1,051
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 17,354	千イギリス・ポンド 23,217
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 2,356	千イスラエル・シケル 2,830
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 7,060	千デンマーク・クローネ 8,562
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 4,563	千ノルウェー・クローネ 1,066
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 8,059	千スウェーデン・クローナ 9,098
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 34,009	千メキシコ・ペソ 31,722
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 69,942	千オフショア・人民元 -
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 8,092	千マレーシア・リンギット 3,048
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 6,845	千ポーランド・ズロチ 10,987
国	ユーロ圏	アイルランド	千ユーロ 3,107	千ユーロ 3,037
		オランダ	8,961	7,954
		ベルギー	8,673	9,501
		フランス	35,154	35,216
		ドイツ	29,446	28,519
		スペイン	20,859	19,722
		イタリア	34,035	34,844
		フィンランド	1,917	1,829
		オーストラリア	5,708	5,408

(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 (2021年2月23日から2022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 584,890	千アメリカ・ドル 583,959	千円 67,190,361	% 47.3	% －	% 21.3	% 16.7	% 9.3
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 30,950	千カナダ・ドル 31,321	千円 2,828,620	2.0	－	1.0	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 26,270	千オーストラリア・ドル 26,417	千円 2,185,214	1.5	－	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,070	千シンガポール・ドル 7,353	千円 629,080	0.4	－	0.3	0.1	0.1
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 45,350	千イギリス・ポンド 52,558	千円 8,228,549	5.8	－	4.4	0.8	0.6
イ ス ラ エ ル	千イスラエル・シェケル 15,260	千イスラエル・シェケル 16,525	千円 593,263	0.4	－	0.2	0.1	0.1
デ ン マ ー ク	千デンマーク・クローネ 29,720	千デンマーク・クローネ 34,886	千円 611,555	0.4	－	0.4	0.1	－
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェー・クローネ 26,720	千ノルウェー・クローネ 26,440	千円 339,233	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 29,060	千スウェーデン・クローナ 31,703	千円 388,054	0.3	－	0.1	0.1	0.0
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 182,626	千メキシコ・ペソ 183,799	千円 1,043,651	0.7	－	0.4	0.2	0.1
中 国	千オフショア・人民元 69,550	千オフショア・人民元 70,200	千円 1,277,451	0.9	－	0.4	0.3	0.2
マ レ ー シ ア	千マレーシア・リンギット 26,830	千マレーシア・リンギット 27,661	千円 759,920	0.5	－	0.3	0.2	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 24,380	千ポーランド・ズロチ 23,028	千円 662,640	0.5	－	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	8,040	8,505	1,108,814	0.8	－	0.6	0.2	0.1
オ ラ ン ダ	17,350	19,673	2,564,646	1.8	－	1.2	0.4	0.2
ベ ル ギ ー	21,000	23,852	3,109,389	2.2	－	1.6	0.4	0.1
フ ラ ン ス	95,460	106,041	13,823,543	9.7	－	6.2	2.6	0.9
ド イ ツ	69,560	78,033	10,172,441	7.2	－	4.3	1.9	1.0
ス ペ イ ン	55,960	61,598	8,030,031	5.7	－	3.6	1.5	0.6
イ タ リ ア	85,330	92,683	12,082,236	8.5	－	5.0	2.4	1.0
フィンランド	6,020	6,268	817,158	0.6	－	0.3	0.2	0.1
オーストリア	13,495	14,981	1,952,943	1.4	－	0.9	0.3	0.2
合 計	－	－	千円 140,398,802	98.9	－	53.9	30.0	15.0

(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	柄	当			期		未						
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日
(アメリカ)					%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円					
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,180	2,246	258,512	2026/01/31							
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	350	355	40,862	2024/01/31							
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	4,980	5,012	576,759	2023/01/31							
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	3,890	3,965	456,290	2024/01/31							
US T N/B 0.125 01/15/24	国債証券	0.1250	5,000	4,874	560,850	2024/01/15							
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	2,490	2,452	282,145	2027/01/31							
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	3,280	3,250	373,976	2025/01/31							
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	3,390	3,174	365,233	2028/01/31							
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	1,500	1,418	163,164	2026/01/31							
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	840	976	112,356	2026/02/15							
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	680	768	88,430	2042/02/15							
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,440	1,624	186,902	2043/02/15							
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,770	1,816	208,954	2046/02/15							
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	900	1,068	122,986	2039/02/15							
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	700	902	103,811	2031/02/15							
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	630	824	94,919	2036/02/15							
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,200	1,659	190,943	2041/02/15							
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,984	228,383	2044/02/15							
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,070	3,512	404,149	2049/02/15							
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	550	719	82,811	2038/02/15							
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	750	1,018	117,206	2040/02/15							
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	4,770	4,360	501,670	2051/02/15							
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	2,180	2,165	249,125	2026/02/15							
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,080	2,127	244,840	2045/02/15							
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,640	1,845	212,366	2047/02/15							
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,540	2,886	332,094	2048/02/15							
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	5,320	5,450	627,135	2024/02/15							
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	4,300	4,338	499,241	2025/02/15							
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,110	4,301	494,897	2029/02/15							
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	2,370	2,484	285,836	2028/02/15							
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	4,370	4,410	507,447	2023/02/15							
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,550	3,622	416,791	2027/02/15							
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,300	1,316	151,436	2024/02/29							
US T N/B 1.5 02/28/23	国債証券	1.5000	1,000	1,003	115,513	2023/02/28							
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,550	2,616	301,058	2026/02/28							
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,660	1,710	196,774	2025/02/28							
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	1,800	1,827	210,279	2023/02/28							
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	6,860	6,409	737,420	2031/02/15							
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	4,110	3,824	440,015	2041/02/15							
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,270	3,079	354,288	2050/02/15							
US T N/B 1.375 02/15/23	国債証券	1.3750	4,000	4,012	461,696	2023/02/15							
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,063	122,319	2027/02/28							
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	2,970	2,881	331,543	2030/02/15							
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	4,000	3,894	448,050	2024/02/15							
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	1,000	983	113,136	2025/02/28							
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	3,020	2,889	332,523	2028/02/29							
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	2,500	2,372	273,020	2026/02/28							
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	4,080	4,130	475,221	2024/03/31							

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	
(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 03/31/23	国 債 証 券	1.5000	2,000	2,007	231,000	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国 債 証 券	2.6250	2,150	2,209	254,220	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国 債 証 券	2.2500	2,260	2,297	264,403	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国 債 証 券	2.5000	3,020	3,065	352,693	2023/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国 債 証 券	0.6250	1,800	1,694	195,021	2027/03/31
US T N/B 0.25 03/15/24	国 債 証 券	0.2500	4,810	4,686	539,213	2024/03/15
US T N/B 0.5 03/31/25	国 債 証 券	0.5000	1,300	1,252	144,149	2025/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28	国 債 証 券	1.2500	2,910	2,801	322,294	2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26	国 債 証 券	0.7500	2,570	2,461	283,275	2026/03/31
US T N/B 0.5 03/15/23	国 債 証 券	0.5000	2,000	1,986	228,603	2023/03/15
US T N/B 1.625 04/30/23	国 債 証 券	1.6250	3,000	3,014	346,892	2023/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国 債 証 券	2.3750	1,760	1,798	206,967	2026/04/30
US T N/B 2.75 04/30/23	国 債 証 券	2.7500	2,490	2,534	291,636	2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国 債 証 券	2.2500	3,300	3,350	385,452	2024/04/30
US T N/B 0.25 04/15/23	国 債 証 券	0.2500	2,000	1,978	227,648	2023/04/15
US T N/B 1.25 04/30/28	国 債 証 券	1.2500	3,170	3,049	350,891	2028/04/30
US T N/B 0.375 04/15/24	国 債 証 券	0.3750	5,000	4,880	561,546	2024/04/15
US T N/B 0.5 04/30/27	国 債 証 券	0.5000	2,000	1,868	215,027	2027/04/30
US T N/B 0.75 04/30/26	国 債 証 券	0.7500	3,000	2,871	330,348	2026/04/30
US T N/B 0.375 04/30/25	国 債 証 券	0.3750	2,000	1,916	220,510	2025/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国 債 証 券	6.2500	710	945	108,785	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国 債 証 券	4.3750	800	1,058	121,762	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国 債 証 券	4.3750	1,040	1,378	158,590	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国 債 証 券	3.0000	980	1,087	125,135	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国 債 証 券	4.2500	810	1,051	121,019	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国 債 証 券	2.8750	1,900	2,061	237,247	2043/05/15
US T N/B 2.375 05/15/51	国 債 証 券	2.3750	4,300	4,403	506,624	2051/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国 債 証 券	3.3750	1,530	1,799	207,027	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国 債 証 券	3.0000	500	556	64,083	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国 債 証 券	3.0000	1,290	1,455	167,456	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国 債 証 券	2.5000	1,810	1,857	213,700	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国 債 証 券	3.1250	1,630	1,896	218,229	2048/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国 債 証 券	1.1250	2,100	1,727	198,775	2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国 債 証 券	2.8750	3,090	3,463	398,477	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国 債 証 券	4.5000	540	717	82,505	2038/05/15
US T N/B 2.25 05/15/41	国 債 証 券	2.2500	3,890	3,839	441,813	2041/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国 債 証 券	1.7500	2,620	2,636	303,364	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国 債 証 券	2.5000	4,240	4,328	497,992	2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国 債 証 券	2.1250	3,320	3,361	386,804	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国 債 証 券	2.8750	4,430	4,683	538,845	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国 債 証 券	2.3750	2,810	2,899	333,573	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国 債 証 券	2.3750	4,700	4,824	555,104	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国 債 証 券	5.0000	500	692	79,692	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国 債 証 券	1.6250	3,090	3,067	352,896	2026/05/15
US T N/B 1.625 05/31/23	国 債 証 券	1.6250	2,900	2,913	335,277	2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国 債 証 券	2.0000	4,770	4,816	554,195	2024/05/31
US T N/B 1.25 05/15/50	国 債 証 券	1.2500	3,780	2,961	340,805	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国 債 証 券	2.1250	2,050	2,075	238,821	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国 債 証 券	1.6250	6,740	6,567	755,601	2031/05/15
US T N/B 2.75 05/31/23	国 債 証 券	2.7500	3,270	3,331	383,330	2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国 債 証 券	2.8750	2,530	2,620	301,472	2025/05/31

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 0.5 05/31/27	国 債 証 券	0.5000	1,500	1,398	160,926	2027/05/31
US T N/B 0.125 05/15/23	国 債 証 券	0.1250	3,000	2,960	340,582	2023/05/15
US T N/B 1.25 05/31/28	国 債 証 券	1.2500	4,000	3,844	442,351	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/15/24	国 債 証 券	0.2500	2,000	1,943	223,611	2024/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国 債 証 券	0.6250	4,220	3,807	438,060	2030/05/15
US T N/B 0.75 05/31/26	国 債 証 券	0.7500	3,000	2,868	330,051	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国 債 証 券	0.2500	4,470	4,257	489,888	2025/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国 債 証 券	1.3750	3,460	3,461	398,325	2023/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国 債 証 券	2.7500	790	815	93,823	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国 債 証 券	1.8750	1,450	1,453	167,188	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国 債 証 券	2.6250	1,820	1,851	213,090	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国 債 証 券	1.7500	1,340	1,345	154,794	2024/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国 債 証 券	0.5000	1,540	1,434	165,079	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国 債 証 券	1.2500	3,000	2,881	331,507	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/15/23	国 債 証 券	0.2500	2,800	2,762	317,851	2023/06/15
US T N/B 0.25 06/30/25	国 債 証 券	0.2500	3,000	2,852	328,217	2025/06/30
US T N/B 0.25 06/15/24	国 債 証 券	0.2500	3,780	3,666	421,912	2024/06/15
US T N/B 0.875 06/30/26	国 債 証 券	0.8750	3,310	3,180	365,912	2026/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国 債 証 券	2.8750	1,860	1,928	221,936	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国 債 証 券	1.8750	2,370	2,375	273,331	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国 債 証 券	1.7500	3,690	3,704	426,196	2024/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国 債 証 券	2.7500	3,270	3,336	383,859	2023/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23	国 債 証 券	0.1250	1,600	1,573	181,003	2023/07/15
US T N/B 0.125 07/31/23	国 債 証 券	0.1250	2,640	2,594	298,501	2023/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国 債 証 券	1.0000	3,000	2,833	326,019	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国 債 証 券	0.3750	3,500	3,234	372,176	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国 債 証 券	0.2500	1,000	949	109,262	2025/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国 債 証 券	0.6250	3,200	3,037	349,465	2026/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国 債 証 券	6.2500	1,000	1,072	123,419	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国 債 証 券	3.7500	710	871	100,296	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国 債 証 券	3.8750	1,110	1,379	158,727	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国 債 証 券	2.7500	430	458	52,757	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国 債 証 券	3.1250	1,750	1,982	228,144	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国 債 証 券	4.5000	790	1,056	121,546	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国 債 証 券	3.6250	1,170	1,420	163,489	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国 債 証 券	2.0000	3,690	3,475	399,893	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国 債 証 券	2.8750	740	809	93,126	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国 債 証 券	2.0000	2,680	2,700	310,769	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国 債 証 券	2.7500	1,880	2,034	234,124	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国 債 証 券	2.2500	1,490	1,479	170,247	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国 債 証 券	2.5000	4,330	4,405	506,928	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国 債 証 券	2.3750	3,920	3,993	459,456	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国 債 証 券	2.2500	1,710	1,675	192,809	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国 債 証 券	3.0000	2,710	3,085	355,027	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国 債 証 券	2.2500	2,530	2,583	297,208	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国 債 証 券	1.5000	3,090	3,047	350,619	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国 債 証 券	2.8750	3,730	3,948	454,270	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国 債 証 券	2.7500	1,640	1,694	194,934	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国 債 証 券	1.6250	3,380	3,316	381,610	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国 債 証 券	1.8750	820	825	94,960	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国 債 証 券	2.7500	2,170	2,214	254,829	2023/08/31

銘	柄	当			期		末																	
		種	類	利	率	額	面	金	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 08/15/41		国	債	証	券	1.7500		3,570		3,241		372,977		2041/08/15										
US T N/B 1.125 08/15/40		国	債	証	券	1.1250		3,500		2,867		329,970		2040/08/15										
US T N/B 1.375 08/15/50		国	債	証	券	1.3750		4,040		3,267		375,941		2050/08/15										
US T N/B 1.25 08/15/31		国	債	証	券	1.2500		7,160		6,739		775,493		2031/08/15										
US T N/B 0.625 08/15/30		国	債	証	券	0.6250		5,920		5,322		612,401		2030/08/15										
US T N/B 1.375 08/31/26		国	債	証	券	1.3750		1,100		1,079		124,173		2026/08/31										
US T N/B 1.25 08/31/24		国	債	証	券	1.2500		2,440		2,417		278,180		2024/08/31										
US T N/B 0.25 08/31/25		国	債	証	券	0.2500		1,000		947		109,055		2025/08/31										
US T N/B 0.375 08/15/24		国	債	証	券	0.3750		3,500		3,396		390,848		2024/08/15										
US T N/B 0.125 08/15/23		国	債	証	券	0.1250		2,000		1,963		225,931		2023/08/15										
US T N/B 0.125 08/31/23		国	債	証	券	0.1250		530		520		59,850		2023/08/31										
US T N/B 1.125 08/31/28		国	債	証	券	1.1250		3,000		2,853		328,352		2028/08/31										
US T N/B 0.5 08/31/27		国	債	証	券	0.5000		4,340		4,030		463,722		2027/08/31										
US T N/B 0.75 08/31/26		国	債	証	券	0.7500		4,000		3,814		438,917		2026/08/31										
US T N/B 3.0 09/30/25		国	債	証	券	3.0000		1,410		1,470		169,205		2025/09/30										
US T N/B 2.125 09/30/24		国	債	証	券	2.1250		2,930		2,966		341,339		2024/09/30										
US T N/B 1.375 09/30/23		国	債	証	券	1.3750		1,500		1,499		172,549		2023/09/30										
US T N/B 2.875 09/30/23		国	債	証	券	2.8750		840		859		98,938		2023/09/30										
US T N/B 0.125 09/15/23		国	債	証	券	0.1250		2,000		1,961		225,697		2023/09/15										
US T N/B 0.375 09/30/27		国	債	証	券	0.3750		1,050		967		111,270		2027/09/30										
US T N/B 0.25 09/30/23		国	債	証	券	0.2500		2,500		2,455		282,514		2023/09/30										
US T N/B 1.625 09/30/26		国	債	証	券	1.6250		1,900		1,883		216,718		2026/09/30										
US T N/B 1.25 09/30/28		国	債	証	券	1.2500		3,000		2,875		330,846		2028/09/30										
US T N/B 0.25 09/30/25		国	債	証	券	0.2500		3,000		2,840		326,815		2025/09/30										
US T N/B 0.875 09/30/26		国	債	証	券	0.8750		2,370		2,270		261,294		2026/09/30										
US T N/B 0.375 09/15/24		国	債	証	券	0.3750		2,000		1,937		222,946		2024/09/15										
US T N/B 2.25 10/31/24		国	債	証	券	2.2500		2,000		2,031		233,787		2024/10/31										
US T N/B 3.0 10/31/25		国	債	証	券	3.0000		1,920		2,002		230,442		2025/10/31										
US T N/B 1.625 10/31/23		国	債	証	券	1.6250		4,500		4,514		519,388		2023/10/31										
US T N/B 2.875 10/31/23		国	債	証	券	2.8750		3,690		3,779		434,853		2023/10/31										
US T N/B 1.625 10/31/26		国	債	証	券	1.6250		1,350		1,338		153,996		2026/10/31										
US T N/B 1.375 10/31/28		国	債	証	券	1.3750		4,000		3,862		444,455		2028/10/31										
US T N/B 1.5 10/31/24		国	債	証	券	1.5000		2,200		2,191		252,123		2024/10/31										
US T N/B 0.5 10/31/27		国	債	証	券	0.5000		3,000		2,778		319,655		2027/10/31										
US T N/B 1.125 10/31/26		国	債	証	券	1.1250		2,000		1,937		222,892		2026/10/31										
US T N/B 0.625 10/15/24		国	債	証	券	0.6250		3,500		3,410		392,359		2024/10/15										
US T N/B 0.25 10/31/25		国	債	証	券	0.2500		2,000		1,890		217,463		2025/10/31										
US T N/B 5.25 11/15/28		国	債	証	券	5.2500		850		1,030		118,560		2028/11/15										
US T N/B 6.125 11/15/27		国	債	証	券	6.1250		900		1,108		127,573		2027/11/15										
US T N/B 3.0 11/15/44		国	債	証	券	3.0000		1,790		1,990		229,031		2044/11/15										
US T N/B 4.25 11/15/40		国	債	証	券	4.2500		510		663		76,330		2040/11/15										
US T N/B 2.75 11/15/42		国	債	証	券	2.7500		1,220		1,300		149,607		2042/11/15										
US T N/B 3.125 11/15/41		国	債	証	券	3.1250		760		857		98,608		2041/11/15										
US T N/B 3.75 11/15/43		国	債	証	券	3.7500		1,360		1,682		193,639		2043/11/15										
US T N/B 2.75 11/15/47		国	債	証	券	2.7500		2,140		2,316		266,523		2047/11/15										
US T N/B 1.625 11/15/50		国	債	証	券	1.6250		4,400		3,786		435,703		2050/11/15										
US T N/B 1.875 11/15/51		国	債	証	券	1.8750		3,700		3,389		389,951		2051/11/15										
US T N/B 3.0 11/15/45		国	債	証	券	3.0000		650		726		83,611		2045/11/15										
US T N/B 2.875 11/15/46		国	債	証	券	2.8750		920		1,011		116,391		2046/11/15										
US T N/B 2.25 11/15/24		国	債	証	券	2.2500		4,690		4,768		548,611		2024/11/15										
US T N/B 4.375 11/15/39		国	債	証	券	4.3750		910		1,199		138,021		2039/11/15										

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 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	2,660	3,242	373,069	2048/11/15		
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	2,827	325,339	2049/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	4,690	4,767	548,526	2025/11/15		
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	3,670	3,949	454,385	2028/11/15		
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	5,520	5,642	649,272	2023/11/15		
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,140	2,157	248,248	2026/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,335	383,829	2027/11/15		
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	2,000	2,023	232,852	2023/11/30		
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	2,810	2,401	276,361	2040/11/15		
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	1,770	1,678	193,091	2041/11/15		
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,794	206,452	2026/11/30		
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	1,940	1,919	220,879	2029/11/15		
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	3,520	3,344	384,823	2031/11/15		
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	6,000	5,497	632,515	2030/11/15		
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	2,000	1,862	214,326	2027/11/30		
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	2,000	1,948	224,196	2026/11/30		
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	2,000	1,946	223,971	2028/11/30		
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	2,000	1,991	229,167	2024/11/30		
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	2,590	2,456	282,592	2025/11/30		
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	1,490	1,454	167,340	2024/11/15		
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,124	359,482	2023/12/31		
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,361	271,659	2025/12/31		
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	3,048	350,735	2024/12/31		
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	1,740	1,735	199,641	2026/12/31		
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,952	224,672	2023/12/15		
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	1,390	1,353	155,753	2026/12/31		
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,600	1,603	184,484	2024/12/31		
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	1,500	1,447	166,596	2028/12/31		
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,841	326,950	2025/12/31		
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	2,430	2,260	260,078	2027/12/31		
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	3,710	3,643	419,185	2024/12/15		
小計	—	—	584,890	583,959	67,190,361	—		
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円			
CANADA 0.25 02/01/23	国債証券	0.2500	500	495	44,751	2023/02/01		
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	200	197	17,807	2024/02/01		
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	537	48,581	2024/03/01		
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	460	462	41,759	2023/03/01		
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	692	62,548	2025/03/01		
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,300	1,228	110,932	2026/03/01		
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	400	390	35,242	2027/03/01		
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,461	131,967	2024/04/01		
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	1,000	988	89,230	2023/05/01		
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	695	62,790	2026/06/01		
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,000	1,271	114,826	2029/06/01		
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	520	715	64,624	2033/06/01		
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	390	535	48,333	2037/06/01		
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,550	1,583	143,008	2024/06/01		
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	540	695	62,770	2041/06/01		
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,212	109,543	2023/06/01		
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	420	426	38,543	2028/06/01		
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	900	918	82,937	2025/06/01		

銘	柄	当			期		未							
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日	
(カナダ)		国	債	証	券	%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円					
CANADA 1.0 06/01/27						1.0000	700	675	60,979					2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29						2.2500	610	630	56,956					2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30						1.2500	1,810	1,734	156,601					2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31						1.5000	1,970	1,907	172,277					2031/06/01
CANADA 0.25 08/01/23						0.2500	700	689	62,232					2023/08/01
CANADA 1.5 09/01/24						1.5000	440	439	39,675					2024/09/01
CANADA 2.0 09/01/23						2.0000	880	888	80,238					2023/09/01
CANADA 0.5 09/01/25						0.5000	1,550	1,488	134,402					2025/09/01
CANADA 1.0 09/01/26						1.0000	1,070	1,036	93,644					2026/09/01
CANADA 0.5 11/01/23						0.5000	620	610	55,141					2023/11/01
CANADA 3.5 12/01/45						3.5000	610	759	68,622					2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48						2.7500	580	648	58,602					2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51						2.0000	2,430	2,348	212,098					2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53						1.7500	710	639	57,733					2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64						2.7500	350	400	36,137					2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30						0.5000	1,500	1,338	120,867					2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31						1.5000	600	578	52,208					2031/12/01
小計		—		—		—	30,950	31,321	2,828,620	—		—		—
(オーストラリア)		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					
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47						3.0000	760	785	64,983					2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25						3.2500	190	199	16,492					2025/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24						2.7500	1,480	1,528	126,464					2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26						4.2500	1,810	1,985	164,228					2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23						5.5000	1,120	1,181	97,774					2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29						3.2500	1,000	1,075	88,946					2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33						4.5000	880	1,073	88,815					2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37						3.7500	760	879	72,734					2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28						2.2500	800	810	67,006					2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30						2.5000	1,550	1,587	131,338					2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41						2.7500	740	743	61,485					2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32						1.2500	990	900	74,452					2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39						3.2500	620	672	55,650					2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31						1.5000	1,300	1,221	101,046					2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35						2.7500	530	550	45,578					2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51						1.7500	930	736	60,943					2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26						0.5000	310	291	24,079					2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28						2.7500	1,160	1,208	99,940					2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27						2.7500	1,630	1,697	140,408					2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29						2.7500	1,260	1,316	108,875					2029/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32						1.7500	900	855	70,797					2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31						1.0000	1,600	1,427	118,110					2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25						0.2500	1,450	1,370	113,335					2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24						0.2500	940	908	75,142					2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30						1.0000	1,560	1,409	116,583					2030/12/21
小計		—		—		—	26,270	26,417	2,185,214	—		—		—
(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	千円					
SINGAPORE 2.0 02/01/24						2.0000	280	284	24,320					2024/02/01
SINGAPORE 1.75 02/01/23						1.7500	200	201	17,243					2023/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27						3.5000	730	789	67,560					2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46						2.7500	420	465	39,811					2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50						1.8750	440	412	35,308					2050/03/01

銘	柄	当			期		末	
		種	類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(シンガポール)				%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 2.75	04/01/42	国	債 証 券	2.7500	380	418	35,777	2042/04/01
SINGAPORE 2.625	05/01/28	国	債 証 券	2.6250	380	396	33,923	2028/05/01
SINGAPORE 2.375	06/01/25	国	債 証 券	2.3750	340	350	29,947	2025/06/01
SINGAPORE 2.125	06/01/26	国	債 証 券	2.1250	420	428	36,631	2026/06/01
SINGAPORE 2.875	07/01/29	国	債 証 券	2.8750	470	500	42,793	2029/07/01
SINGAPORE 2.375	07/01/39	国	債 証 券	2.3750	180	185	15,907	2039/07/01
SINGAPORE 2.75	07/01/23	国	債 証 券	2.7500	700	715	61,239	2023/07/01
SINGAPORE 1.625	07/01/31	国	債 証 券	1.6250	200	193	16,586	2031/07/01
SINGAPORE 2.25	08/01/36	国	債 証 券	2.2500	480	486	41,584	2036/08/01
SINGAPORE 3.0	09/01/24	国	債 証 券	3.0000	550	572	48,948	2024/09/01
SINGAPORE 2.875	09/01/30	国	債 証 券	2.8750	370	395	33,869	2030/09/01
SINGAPORE 3.375	09/01/33	国	債 証 券	3.3750	280	316	27,103	2033/09/01
SINGAPORE 1.875	10/01/51	国	債 証 券	1.8750	50	47	4,041	2051/10/01
SINGAPORE 0.5	11/01/25	国	債 証 券	0.5000	200	192	16,482	2025/11/01
小	計	—	—	—	7,070	7,353	629,080	—
(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	910	1,198	187,615	2044/01/22
UK TREASURY 3.5	01/22/45	国	債 証 券	3.5000	1,080	1,487	232,834	2045/01/22
UK TREASURY 4.0	01/22/60	国	債 証 券	4.0000	770	1,369	214,476	2060/01/22
UK TREASURY 1.75	01/22/49	国	債 証 券	1.7500	510	537	84,226	2049/01/22
UK TREASURY 0.875	01/31/46	国	債 証 券	0.8750	760	657	102,874	2046/01/31
UK TREASURY 1.125	01/31/39	国	債 証 券	1.1250	390	365	57,179	2039/01/31
UK TREASURY 0.125	01/31/24	国	債 証 券	0.1250	1,800	1,760	275,652	2024/01/31
UK TREASURY 0.5	01/31/29	国	債 証 券	0.5000	400	378	59,298	2029/01/31
UK TREASURY 0.125	01/31/28	国	債 証 券	0.1250	500	468	73,305	2028/01/31
UK TREASURY 0.125	01/31/23	国	債 証 券	0.1250	1,500	1,486	232,735	2023/01/31
UK TREASURY 0.125	01/30/26	国	債 証 券	0.1250	800	766	119,924	2026/01/30
UK TREASURY 5.0	03/07/25	国	債 証 券	5.0000	1,310	1,455	227,867	2025/03/07
UK TREASURY 4.25	03/07/36	国	債 証 券	4.2500	890	1,197	187,505	2036/03/07
UK TREASURY 1.0	04/22/24	国	債 証 券	1.0000	1,470	1,462	229,020	2024/04/22
UK TREASURY 4.25	06/07/32	国	債 証 券	4.2500	1,010	1,283	200,906	2032/06/07
UK TREASURY 0.625	06/07/25	国	債 証 券	0.6250	750	735	115,172	2025/06/07
UK TREASURY 1.5	07/22/47	国	債 証 券	1.5000	1,030	1,025	160,497	2047/07/22
UK TREASURY 1.25	07/31/51	国	債 証 券	1.2500	390	367	57,480	2051/07/31
UK TREASURY 3.75	07/22/52	国	債 証 券	3.7500	870	1,352	211,735	2052/07/22
UK TREASURY 1.75	07/22/57	国	債 証 券	1.7500	1,210	1,322	207,050	2057/07/22
UK TREASURY 2.5	07/22/65	国	債 証 券	2.5000	980	1,365	213,801	2065/07/22
UK TREASURY 3.5	07/22/68	国	債 証 券	3.5000	960	1,692	264,929	2068/07/22
UK TREASURY 1.5	07/22/26	国	債 証 券	1.5000	800	809	126,754	2026/07/22
UK TREASURY 1.25	07/22/27	国	債 証 券	1.2500	700	701	109,749	2027/07/22
UK TREASURY 0.75	07/22/23	国	債 証 券	0.7500	960	954	149,441	2023/07/22
UK TREASURY 0.875	07/31/33	国	債 証 券	0.8750	450	423	66,261	2033/07/31
UK TREASURY 0.25	07/31/31	国	債 証 券	0.2500	1,600	1,440	225,486	2031/07/31
UK TREASURY 0.625	07/31/35	国	債 証 券	0.6250	800	711	111,373	2035/07/31
UK TREASURY 4.25	09/07/39	国	債 証 券	4.2500	720	1,022	160,094	2039/09/07
UK TREASURY 2.25	09/07/23	国	債 証 券	2.2500	980	994	155,756	2023/09/07
UK TREASURY 2.75	09/07/24	国	債 証 券	2.7500	480	497	77,913	2024/09/07
UK TREASURY 2.0	09/07/25	国	債 証 券	2.0000	790	810	126,909	2025/09/07
UK TREASURY 4.5	09/07/34	国	債 証 券	4.5000	860	1,154	180,758	2034/09/07
UK TREASURY 1.75	09/07/37	国	債 証 券	1.7500	1,140	1,171	183,379	2037/09/07
UK TREASURY 1.625	10/22/54	国	債 証 券	1.6250	540	564	88,306	2054/10/22

銘	柄	当			期		末					
		種	類	利	率	額	面	金	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 0.5 10/22/61		国	債証券	0.5000		970		724		113,407		2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71		国	債証券	1.6250		500		571		89,527		2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41		国	債証券	1.2500		1,040		985		154,333		2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50		国	債証券	0.6250		360		289		45,252		2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28		国	債証券	1.6250		930		953		149,261		2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29		国	債証券	0.8750		910		883		138,310		2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30		国	債証券	0.3750		600		553		86,710		2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26		国	債証券	0.3750		1,130		1,083		169,622		2026/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28		国	債証券	6.0000		560		732		114,725		2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38		国	債証券	4.7500		880		1,302		203,854		2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42		国	債証券	4.5000		980		1,496		234,327		2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46		国	債証券	4.2500		1,000		1,557		243,803		2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55		国	債証券	4.2500		1,020		1,784		279,345		2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27		国	債証券	4.2500		780		910		142,526		2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40		国	債証券	4.2500		860		1,240		194,254		2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30		国	債証券	4.7500		870		1,118		175,105		2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49		国	債証券	4.2500		850		1,379		215,906		2049/12/07
小計		—		—		45,350		52,558		8,228,549		—
(イスラエル)					%	千イスラエル・シェケル		千イスラエル・シェケル		千円		
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42		国	債証券	5.5000		1,300		1,939		69,626		2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47		国	債証券	3.7500		1,390		1,668		59,882		2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27		国	債証券	2.0000		2,610		2,729		97,979		2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24		国	債証券	3.7500		2,100		2,237		80,332		2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30		国	債証券	1.0000		1,350		1,299		46,637		2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23		国	債証券	4.2500		2,320		2,422		86,951		2023/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37		国	債証券	1.5000		1,000		906		32,543		2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25		国	債証券	1.7500		2,030		2,091		75,096		2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28		国	債証券	2.2500		1,160		1,231		44,214		2028/09/28
小計		—		—		15,260		16,525		593,263		—
(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		2,020		1,812		31,777		2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39		国	債証券	4.5000		7,580		12,594		220,783		2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25		国	債証券	1.7500		5,320		5,663		99,274		2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27		国	債証券	0.5000		7,130		7,244		126,993		2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29		国	債証券	0.5000		4,370		4,426		77,595		2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31		国	債証券	0.0000		3,300		3,144		55,131		2031/11/15
小計		—		—		29,720		34,886		611,555		—
(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		3,706		47,558		2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27		国	債証券	1.7500		1,900		1,878		24,102		2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24		国	債証券	3.0000		5,800		5,950		76,342		2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25		国	債証券	1.7500		3,800		3,784		48,551		2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28		国	債証券	2.0000		2,070		2,064		26,486		2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23		国	債証券	2.0000		1,800		1,814		23,276		2023/05/24
NORWAY 1.375 08/19/30		国	債証券	1.3750		3,730		3,529		45,283		2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29		国	債証券	1.7500		2,750		2,691		34,538		2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31		国	債証券	1.2500		1,100		1,020		13,095		2031/09/17
小計		—		—		26,720		26,440		339,233		—
(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		4,718		57,750		2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28		国	債証券	0.7500		1,840		1,865		22,828		2028/05/12

銘柄	柄	当		期			未																		
		種	類	利	率	評		価	額																
						外				貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額						
		種	類	利	率	額	面	金	額	外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額	償	還	年	月	日
(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 2.5 05/12/25		国	債	証	券	2.5000	7,980	8,544	104,583																
SWEDEN 0.125 05/12/31		国	債	証	券	0.1250	2,150	2,061	25,236																
SWEDEN 2.25 06/01/32		国	債	証	券	2.2500	2,700	3,147	38,531																
SWEDEN 1.5 11/13/23		国	債	証	券	1.5000	4,700	4,821	59,017																
SWEDEN 1.0 11/12/26		国	債	証	券	1.0000	3,250	3,330	40,769																
SWEDEN 0.75 11/12/29		国	債	証	券	0.7500	3,170	3,213	39,335																
小計		—	—	—	—	—	29,060	31,703	388,054	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
(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	22,143	20,617	117,071																
MEXICAN BONDS 03/09/23		国	債	証	券	6.7500	8,000	7,945	45,118																
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29		国	債	証	券	8.5000	17,109	17,831	101,253																
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31		国	債	証	券	7.7500	17,000	16,945	96,218																
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27		国	債	証	券	7.5000	18,071	17,883	101,546																
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24		国	債	証	券	8.0000	18,000	18,103	102,793																
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42		国	債	証	券	7.7500	11,643	11,266	63,973																
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47		国	債	証	券	8.0000	12,654	12,543	71,223																
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38		国	債	証	券	8.5000	13,125	13,738	78,010																
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36		国	債	証	券	10.0000	5,085	6,015	34,156																
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34		国	債	証	券	7.7500	6,000	5,948	33,775																
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24		国	債	証	券	10.0000	19,796	20,900	118,678																
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23		国	債	証	券	8.0000	14,000	14,059	79,832																
小計		—	—	—	—	—	182,626	183,799	1,043,651	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
(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 3.72 04/12/51		国	債	証	券	3.7200	1,100	1,166	21,228																
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30		国	債	証	券	2.6800	6,000	5,914	107,628																
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26		国	債	証	券	2.6900	17,000	17,130	311,720																
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24		国	債	証	券	2.4700	5,000	5,024	91,437																
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51		国	債	証	券	3.5300	4,950	5,121	93,188																
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28		国	債	証	券	2.9100	14,500	14,631	266,248																
CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23		国	債	証	券	2.5600	15,000	15,083	274,470																
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31		国	債	証	券	2.8900	3,000	3,023	55,026																
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27		国	債	証	券	3.2800	3,000	3,104	56,500																
小計		—	—	—	—	—	69,550	70,200	1,277,451	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
(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	817	22,469																
MALAYSIA 3.48 03/15/23		国	債	証	券	3.4800	1,220	1,239	34,042																
MALAYSIA 4.392 04/15/26		国	債	証	券	4.3920	3,070	3,208	88,140																
MALAYSIA 4.498 04/15/30		国	債	証	券	4.4980	1,800	1,898	52,164																
MALAYSIA 3.844 04/15/33		国	債	証	券	3.8440	1,210	1,204	33,102																
MALAYSIA 4.762 04/07/37		国	債	証	券	4.7620	1,400	1,518	41,716																
MALAYSIA 2.632 04/15/31		国	債	証	券	2.6320	1,000	917	25,192																
MALAYSIA 3.733 06/15/28		国	債	証	券	3.7330	2,000	2,015	55,366																
MALAYSIA 3.478 06/14/24		国	債	証	券	3.4780	1,000	1,016	27,921																
MALAYSIA 4.181 07/15/24		国	債	証	券	4.1810	2,430	2,505	68,829																
MALAYSIA 4.921 07/06/48		国	債	証	券	4.9210	2,700	2,849	78,268																
MALAYSIA 3.828 07/05/34		国	債	証	券	3.8280	1,700	1,666	45,788																
MALAYSIA 3.955 09/15/25		国	債	証	券	3.9550	2,700	2,785	76,521																
MALAYSIA 4.935 09/30/43		国	債	証	券	4.9350	2,000	2,153	59,172																
MALAYSIA 3.9 11/30/26		国	債	証	券	3.9000	500	513	14,096																
MALAYSIA 3.899 11/16/27		国	債	証	券	3.8990	800	819	22,508																
MALAYSIA 4.642 11/07/33		国	債	証	券	4.6420	500	532	14,619																
小計		—	—	—	—	—	26,830	27,661	759,920	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,613	46,426	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	2,910	2,738	78,807	2028/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,240	64,471	2024/04/25
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	2,680	2,451	70,538	2025/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,180	2,068	59,511	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,343	67,436	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,250	2,097	60,362	2027/07/25
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	2,740	2,760	79,430	2023/10/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	210	194	5,590	2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	1,000	967	27,838	2024/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,900	2,362	67,981	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,400	1,190	34,246	2026/10/25
小計	—	—	24,380	23,028	662,640	—
(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	600	715	93,311	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	270	289	37,710	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	320	344	44,947	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	710	831	108,340	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	570	596	77,813	2023/03/20
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	220	201	26,216	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	420	448	58,429	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	340	358	46,691	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	630	729	95,067	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	390	405	52,905	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	520	544	71,027	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	640	666	86,860	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	390	431	56,310	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	350	327	42,749	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	560	560	73,123	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	660	616	80,393	2031/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	450	436	56,912	2030/10/18
小計	—	—	8,040	8,505	1,108,814	—
(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	1,130	1,820	237,294	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,140	1,731	225,699	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	610	507	66,184	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	850	1,107	144,358	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,060	1,590	207,300	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	980	1,197	156,063	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	400	366	47,727	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	630	628	81,879	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	1,310	1,321	172,313	2024/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	270	265	34,662	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	920	918	119,747	2027/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	450	464	60,613	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,130	1,155	150,680	2026/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,130	1,194	155,728	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,280	1,298	169,317	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	980	1,019	132,861	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,000	1,038	135,341	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	790	792	103,283	2029/07/15

銘	柄	当		期			末						
		種	類	利	率	額	面	金	額	償還年月日			
											外	貨	建
(ユーロ…オランダ)					%			千ユーロ		千ユーロ		千円	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30		国	債	証	券	0.0000		750		732		95,503	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31		国	債	証	券	0.0000		540		522		68,087	2031/07/15
小計		—	—	—	—	17,350		17,350		19,673		2,564,646	—
(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		1,190		1,579		205,883	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41		国	債	証	券	4.2500		1,110		1,726		225,101	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26		国	債	証	券	4.5000		430		511		66,618	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32		国	債	証	券	4.0000		730		975		127,215	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35		国	債	証	券	5.0000		890		1,356		176,852	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33		国	債	証	券	1.2500		710		757		98,749	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45		国	債	証	券	3.7500		520		802		104,603	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47		国	債	証	券	1.6000		670		730		95,183	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50		国	債	証	券	1.7000		670		742		96,847	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57		国	債	証	券	2.2500		350		442		57,642	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66		国	債	証	券	2.1500		420		528		68,887	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71		国	債	証	券	0.6500		330		239		31,190	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26		国	債	証	券	1.0000		1,110		1,156		150,786	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24		国	債	証	券	2.6000		1,020		1,089		142,056	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31		国	債	証	券	1.0000		930		967		126,153	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23		国	債	証	券	2.2500		830		860		112,180	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28		国	債	証	券	0.8000		670		692		90,232	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40		国	債	証	券	0.4000		430		384		50,166	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29		国	債	証	券	0.9000		1,050		1,091		142,303	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34		国	債	証	券	3.0000		590		745		97,225	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38		国	債	証	券	1.9000		520		597		77,842	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25		国	債	証	券	0.8000		1,140		1,175		153,216	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27		国	債	証	券	0.8000		840		869		113,351	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37		国	債	証	券	1.4500		440		473		61,703	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30		国	債	証	券	0.1000		800		774		101,002	2030/06/22
BELGIUM 0.5 10/22/24		国	債	証	券	0.5000		670		684		89,179	2024/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/31		国	債	証	券	0.0000		770		724		94,451	2031/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23		国	債	証	券	0.2000		660		667		86,984	2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27		国	債	証	券	0.0000		510		504		65,775	2027/10/22
小計		—	—	—	—	21,000		21,000		23,852		3,109,389	—
(ユーロ…フランス)					%			千ユーロ		千ユーロ		千円	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23		国	債	証	券	0.0000		900		905		118,033	2023/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/27		国	債	証	券	0.0000		900		893		116,427	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26		国	債	証	券	0.0000		2,460		2,459		320,568	2026/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/24		国	債	証	券	0.0000		1,150		1,158		151,067	2024/02/25
FRANCE OAT 03/25/24		国	債	証	券	0.0000		2,520		2,538		330,929	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25		国	債	証	券	0.0000		2,970		2,982		388,857	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23		国	債	証	券	0.0000		2,200		2,214		288,740	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23		国	債	証	券	8.5000		1,030		1,139		148,583	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26		国	債	証	券	3.5000		2,520		2,885		376,190	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41		国	債	証	券	4.5000		2,250		3,645		475,175	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55		国	債	証	券	4.0000		1,260		2,208		287,887	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60		国	債	証	券	4.0000		730		1,332		173,752	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29		国	債	証	券	5.5000		2,540		3,473		452,785	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35		国	債	証	券	4.7500		1,550		2,325		303,111	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45		国	債	証	券	3.2500		1,600		2,317		302,054	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48		国	債	証	券	2.0000		1,690		2,027		264,241	2048/05/25

銘	柄	当			期			末						
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日	
(ユーロ…フランス)					%	千ユーロ		千ユーロ		千円				
FRANCE OAT 1.5 05/25/50		国	債	証	券	1.5000	2,000		2,153		280,743		2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52		国	債	証	券	0.7500	1,890		1,661		216,658		2052/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53		国	債	証	券	0.7500	650		564		73,560		2053/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66		国	債	証	券	1.7500	820		934		121,829		2066/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72		国	債	証	券	0.5000	600		409		53,334		2072/05/25	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24		国	債	証	券	2.2500	1,980		2,095		273,231		2024/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30		国	債	証	券	2.5000	3,240		3,783		493,197		2030/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28		国	債	証	券	0.7500	3,270		3,369		439,218		2028/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31		国	債	証	券	1.5000	3,090		3,351		436,918		2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25		国	債	証	券	0.5000	2,490		2,541		331,291		2025/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29		国	債	証	券	0.5000	2,220		2,240		292,119		2029/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34		国	債	証	券	1.2500	2,540		2,676		348,849		2034/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26		国	債	証	券	0.5000	2,770		2,823		368,124		2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27		国	債	証	券	1.0000	2,460		2,568		334,893		2027/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40		国	債	証	券	0.5000	1,270		1,168		152,287		2040/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23		国	債	証	券	1.7500	2,530		2,604		339,501		2023/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36		国	債	証	券	1.2500	2,590		2,716		354,108		2036/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39		国	債	証	券	1.7500	1,690		1,931		251,834		2039/06/25	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44		国	債	証	券	0.5000	740		658		85,778		2044/06/25	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23		国	債	証	券	4.2500	3,130		3,379		440,558		2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25		国	債	証	券	6.0000	1,800		2,207		287,769		2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27		国	債	証	券	2.7500	2,840		3,255		424,434		2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38		国	債	証	券	4.0000	1,630		2,424		315,993		2038/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32		国	債	証	券	5.7500	2,100		3,213		418,890		2032/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24		国	債	証	券	1.7500	2,380		2,511		327,439		2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25		国	債	証	券	1.0000	2,220		2,306		300,662		2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26		国	債	証	券	0.2500	2,150		2,164		282,208		2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28		国	債	証	券	0.7500	2,420		2,490		324,648		2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31		国	債	証	券	0.0000	2,330		2,190		285,531		2031/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30		国	債	証	券	0.0000	2,800		2,670		348,092		2030/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29		国	債	証	券	0.0000	2,550		2,465		321,428		2029/11/25	
小計		—			—	95,460		106,041		13,823,543		—		
(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		948		123,666		2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28		国	債	証	券	5.6250	1,160		1,551		202,289		2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30		国	債	証	券	6.2500	710		1,060		138,228		2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31		国	債	証	券	5.5000	1,240		1,840		239,989		2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37		国	債	証	券	4.0000	1,640		2,539		331,104		2037/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25		国	債	証	券	0.5000	1,660		1,702		221,937		2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26		国	債	証	券	0.5000	1,810		1,860		242,473		2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29		国	債	証	券	0.2500	1,390		1,413		184,200		2029/02/15	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23		国	債	証	券	1.5000	920		939		122,528		2023/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28		国	債	証	券	0.5000	1,640		1,691		220,524		2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24		国	債	証	券	1.7500	1,750		1,830		238,578		2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27		国	債	証	券	0.2500	1,960		1,994		260,015		2027/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31		国	債	証	券	0.0000	1,660		1,640		213,861		2031/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30		国	債	証	券	0.0000	1,690		1,680		219,101		2030/02/15	
BUNDES OBL 04/14/23		国	債	証	券	0.0000	1,030		1,037		135,296		2023/04/14	
BUNDES OBL 04/05/24		国	債	証	券	0.0000	1,540		1,555		202,804		2024/04/05	
BUNDES OBL 0.0 04/11/25		国	債	証	券	0.0000	1,250		1,261		164,486		2025/04/11	
BUNDES OBL 0.0 04/10/26		国	債	証	券	0.0000	1,430		1,440		187,818		2026/04/10	

銘	柄	当		期			末							
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日	
(ユーロ…ドイツ)					%		千	ユーロ		千	ユーロ	千	円	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24		国	債	証	券	1.5000	1,950		2,035		265,395		2024/05/15	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23		国	債	証	券	1.5000	1,650		1,693		220,794		2023/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35		国	債	証	券	0.0000	1,200		1,150		149,983		2035/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36		国	債	証	券	0.0000	1,350		1,282		167,216		2036/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27		国	債	証	券	6.5000	710		962		125,497		2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28		国	債	証	券	4.7500	1,100		1,438		187,564		2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39		国	債	証	券	4.2500	940		1,571		204,821		2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42		国	債	証	券	3.2500	890		1,406		183,381		2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44		国	債	証	券	2.5000	1,760		2,588		337,393		2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40		国	債	証	券	4.7500	1,140		2,048		267,093		2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34		国	債	証	券	4.7500	1,660		2,590		337,716		2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46		国	債	証	券	2.5000	1,890		2,844		370,749		2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52		国	債	証	券	0.0000	340		293		38,310		2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48		国	債	証	券	1.2500	1,820		2,202		287,112		2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25		国	債	証	券	1.0000	1,470		1,534		200,020		2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27		国	債	証	券	0.5000	2,000		2,061		268,687		2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26		国	債	証	券	0.0000	1,680		1,691		220,559		2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28		国	債	証	券	0.2500	1,810		1,840		239,894		2028/08/15	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23		国	債	証	券	2.0000	2,930		3,045		397,055		2023/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24		国	債	証	券	1.0000	1,340		1,387		180,840		2024/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29		国	債	証	券	0.0000	1,610		1,605		209,236		2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50		国	債	証	券	0.0000	1,720		1,515		197,499		2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31		国	債	証	券	0.0000	700		688		89,817		2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50		国	債	証	券	0.0000	400		354		46,263		2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30		国	債	証	券	0.0000	2,000		1,983		258,522		2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30		国	債	証	券	0.0000	500		497		64,872		2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31		国	債	証	券	0.0000	450		444		57,879		2031/08/15	
BUNDESUBL 10/18/24		国	債	証	券	0.0000	1,130		1,141		148,776		2024/10/18	
BUNDESUBL 10/13/23		国	債	証	券	0.0000	1,280		1,292		168,527		2023/10/13	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26		国	債	証	券	0.0000	1,050		1,056		137,737		2026/10/09	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25		国	債	証	券	0.0000	1,400		1,412		184,079		2025/10/10	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25		国	債	証	券	0.0000	670		677		88,267		2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27		国	債	証	券	0.0000	1,200		1,202		156,812		2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28		国	債	証	券	0.0000	500		499		65,155		2028/11/15	
小	計	—	—	—	—	69,560	78,033	10,172,441	—	—	—	—	—	
(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	1,580		2,146		279,779		2029/01/31	
SPAIN 4.8 01/31/24		国	債	証	券	4.8000	1,130		1,239		161,636		2024/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37		国	債	証	券	4.2000	1,100		1,516		197,750		2037/01/31	
SPAIN 5.4 01/31/23		国	債	証	券	5.4000	1,160		1,224		159,683		2023/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25		国	債	証	券	0.0000	1,400		1,397		182,120		2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27		国	債	証	券	0.0000	350		340		44,369		2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28		国	債	証	券	0.0000	1,160		1,113		145,100		2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26		国	債	証	券	0.0000	800		789		102,872		2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25		国	債	証	券	1.6000	1,450		1,519		198,019		2025/04/30	
SPAIN 3.8 04/30/24		国	債	証	券	3.8000	1,190		1,293		168,562		2024/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27		国	債	証	券	1.5000	1,240		1,300		169,567		2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26		国	債	証	券	1.9500	1,270		1,353		176,490		2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28		国	債	証	券	1.4000	1,440		1,504		196,136		2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29		国	債	証	券	1.4500	1,170		1,223		159,528		2029/04/30	
SPAIN 0.7 04/30/32		国	債	証	券	0.7000	610		580		75,615		2032/04/30	

銘	柄	当		期			末																				
		種	類	利	率	額	面	金	額	外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額	償	還	年	月	日		
(ユーロ…スペイン)					%		千	ユーロ		千	ユーロ		千	円													
SPAIN 0.5 04/30/30		国	債	証	券	0.5000	1,850		1,793		233,770															2030/04/30	
SPAIN 0.1 04/30/31		国	債	証	券	0.1000	1,190		1,087		141,787															2031/04/30	
SPAIN 0.0 04/30/23		国	債	証	券	0.0000	990		995		129,797															2023/04/30	
SPAIN 0.0 05/31/24		国	債	証	券	0.0000	860		860		112,236															2024/05/31	
SPAIN 5.9 07/30/26		国	債	証	券	5.9000	1,370		1,703		222,091															2026/07/30	
SPAIN 4.9 07/30/40		国	債	証	券	4.9000	970		1,494		194,794															2040/07/30	
SPAIN 4.7 07/30/41		国	債	証	券	4.7000	1,250		1,907		248,683															2041/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/66		国	債	証	券	3.4500	920		1,238		161,501															2066/07/30	
SPAIN 4.65 07/30/25		国	債	証	券	4.6500	1,370		1,577		205,608															2025/07/30	
SPAIN 1.95 07/30/30		国	債	証	券	1.9500	1,460		1,580		206,074															2030/07/30	
SPAIN 5.75 07/30/32		国	債	証	券	5.7500	1,220		1,776		231,601															2032/07/30	
SPAIN 2.35 07/30/33		国	債	証	券	2.3500	1,240		1,383		180,316															2033/07/30	
SPAIN 1.4 07/30/28		国	債	証	券	1.4000	1,310		1,367		178,225															2028/07/30	
SPAIN 1.85 07/30/35		国	債	証	券	1.8500	1,200		1,268		165,354															2035/07/30	
SPAIN 0.25 07/30/24		国	債	証	券	0.2500	1,240		1,249		162,917															2024/07/30	
SPAIN 0.35 07/30/23		国	債	証	券	0.3500	1,420		1,434		187,009															2023/07/30	
SPAIN 0.85 07/30/37		国	債	証	券	0.8500	600		544		70,953															2037/07/30	
SPAIN 1.0 07/30/42		国	債	証	券	1.0000	130		115		15,067															2042/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/27		国	債	証	券	0.8000	1,200		1,211		157,965															2027/07/30	
SPAIN 2.75 10/31/24		国	債	証	券	2.7500	1,540		1,655		215,832															2024/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/28		国	債	証	券	5.1500	1,030		1,326		172,940															2028/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/44		国	債	証	券	5.1500	910		1,514		197,484															2044/10/31	
SPAIN 2.9 10/31/46		国	債	証	券	2.9000	1,060		1,310		170,797															2046/10/31	
SPAIN 2.7 10/31/48		国	債	証	券	2.7000	930		1,112		145,026															2048/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/71		国	債	証	券	1.4500	300		227		29,687															2071/10/31	
SPAIN 1.0 10/31/50		国	債	証	券	1.0000	1,170		950		123,969															2050/10/31	
SPAIN 2.15 10/31/25		国	債	証	券	2.1500	1,380		1,475		192,408															2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27		国	債	証	券	1.4500	1,500		1,570		204,667															2027/10/31	
SPAIN 1.3 10/31/26		国	債	証	券	1.3000	1,460		1,520		198,168															2026/10/31	
SPAIN 0.6 10/31/29		国	債	証	券	0.6000	1,180		1,159		151,089															2029/10/31	
SPAIN 4.4 10/31/23		国	債	証	券	4.4000	1,110		1,198		156,228															2023/10/31	
SPAIN 0.5 10/31/31		国	債	証	券	0.5000	1,100		1,036		135,128															2031/10/31	
SPAIN 1.2 10/31/40		国	債	証	券	1.2000	1,080		1,005		131,124															2040/10/31	
SPAIN 1.25 10/31/30		国	債	証	券	1.2500	1,370		1,399		182,486															2030/10/31	
小	計	—			—		55,960		61,598		8,030,031															—	
(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	1,300		1,291		168,400															2027/01/15	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24		国	債	証	券	0.0000	1,000		998		130,164															2024/01/15	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33		国	債	証	券	5.7500	1,280		1,783		232,520															2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37		国	債	証	券	4.0000	1,660		2,072		270,150															2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28		国	債	証	券	2.0000	1,430		1,497		195,200															2028/02/01	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25		国	債	証	券	0.3500	1,080		1,075		140,225															2025/02/01	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26		国	債	証	券	0.5000	1,400		1,386		180,688															2026/02/01	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47		国	債	証	券	2.7000	1,120		1,190		155,201															2047/03/01	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48		国	債	証	券	3.4500	1,020		1,227		159,980															2048/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24		国	債	証	券	4.5000	1,390		1,512		197,148															2024/03/01	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67		国	債	証	券	2.8000	590		597		77,858															2067/03/01	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72		国	債	証	券	2.1500	320		272		35,457															2072/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25		国	債	証	券	5.0000	1,790		2,031		264,838															2025/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26		国	債	証	券	4.5000	1,630		1,872		244,062															2026/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32		国	債	証	券	1.6500	1,320		1,307		170,477															2032/03/01	

銘	柄	当			期		未	
		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 3.1 03/01/40		国	債 証 券	3.1000	820	929	121,160	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35		国	債 証 券	3.3500	1,010	1,168	152,264	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30		国	債 証 券	3.5000	1,540	1,774	231,373	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23		国	債 証 券	0.9500	1,070	1,084	141,403	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23		国	債 証 券	0.9500	920	932	121,560	2023/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36		国	債 証 券	1.4500	900	839	109,392	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41		国	債 証 券	1.8000	770	715	93,310	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37		国	債 証 券	0.9500	900	771	100,534	2037/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28		国	債 証 券	0.2500	1,080	1,017	132,594	2028/03/15
ITALY BTPS 1.5 04/30/45		国	債 証 券	1.5000	590	504	65,821	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30		国	債 証 券	1.3500	1,110	1,093	142,518	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31		国	債 証 券	0.9000	1,000	930	121,342	2031/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/15/24		国	債 証 券	0.0000	1,000	994	129,643	2024/04/15
ITALY BTPS 0.0 04/01/26		国	債 証 券	0.0000	990	956	124,655	2026/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31		国	債 証 券	6.0000	1,470	2,019	263,279	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23		国	債 証 券	4.5000	1,400	1,480	192,978	2023/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24		国	債 証 券	1.8500	810	839	109,403	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25		国	債 証 券	1.4500	1,340	1,378	179,643	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26		国	債 証 券	1.6000	1,100	1,135	148,013	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25		国	債 証 券	1.5000	1,460	1,504	196,073	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27		国	債 証 券	2.2000	920	974	127,019	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32		国	債 証 券	0.9500	240	220	28,724	2032/06/01
ITALY BTPS 0.6 06/15/23		国	債 証 券	0.6000	500	505	65,929	2023/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26		国	債 証 券	2.1000	680	716	93,373	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24		国	債 証 券	1.7500	1,200	1,239	161,638	2024/07/01
ITALY BTPS 0.5 07/15/28		国	債 証 券	0.5000	500	475	61,960	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25		国	債 証 券	1.8500	900	937	122,157	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34		国	債 証 券	5.0000	1,610	2,160	281,700	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39		国	債 証 券	5.0000	1,330	1,875	244,464	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23		国	債 証 券	4.7500	1,900	2,034	265,239	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27		国	債 証 券	2.0500	1,040	1,092	142,411	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29		国	債 証 券	3.0000	1,330	1,478	192,718	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31		国	債 証 券	0.6000	1,610	1,450	189,092	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30		国	債 証 券	0.9500	1,170	1,107	144,315	2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23		国	債 証 券	0.3000	1,000	1,006	131,207	2023/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26		国	債 証 券	0.0000	600	576	75,134	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38		国	債 証 券	2.9500	940	1,041	135,760	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44		国	債 証 券	4.7500	970	1,387	180,919	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46		国	債 証 券	3.2500	990	1,153	150,425	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28		国	債 証 券	4.7500	1,680	2,044	266,502	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40		国	債 証 券	5.0000	1,390	1,982	258,409	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50		国	債 証 券	2.4500	970	968	126,221	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51		国	債 証 券	1.7000	900	761	99,299	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33		国	債 証 券	2.4500	1,140	1,209	157,653	2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52		国	債 証 券	2.1500	400	371	48,394	2052/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24		国	債 証 券	3.7500	1,210	1,313	171,238	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49		国	債 証 券	3.8500	570	731	95,390	2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36		国	債 証 券	2.2500	690	707	92,242	2036/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27		国	債 証 券	0.9500	1,430	1,417	184,755	2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23		国	債 証 券	0.6500	980	991	129,249	2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23		国	債 証 券	2.4500	930	967	126,187	2023/10/01

銘	柄	当		期			末						
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日
(ユーロ…イタリア)					%			千ユーロ		千ユーロ		千円	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23		国	債	証	券	9.0000	1,190			1,370		178,690	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26		国	債	証	券	7.2500	350			452		58,980	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27		国	債	証	券	6.5000	1,790			2,321		302,647	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29		国	債	証	券	5.2500	2,050			2,626		342,385	2029/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24		国	債	証	券	1.4500	1,040			1,068		139,252	2024/11/15
ITALY BTPS 2.5 11/15/25		国	債	証	券	2.5000	550			586		76,490	2025/11/15
ITALY BTPS 2.0 12/01/25		国	債	証	券	2.0000	970			1,017		132,608	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26		国	債	証	券	1.2500	1,230			1,249		162,836	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24		国	債	証	券	2.5000	1,170			1,236		161,223	2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28		国	債	証	券	2.8000	1,000			1,096		142,937	2028/12/01
ITALY BTPS 0.95 12/01/31		国	債	証	券	0.9500	1,180			1,093		142,509	2031/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30		国	債	証	券	1.6500	1,480			1,477		192,595	2030/12/01
小	計	—		—		85,330				92,683		12,082,236	—
(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	220			177		23,186	2052/04/15
FINLAND 2.0 04/15/24		国	債	証	券	2.0000	260			273		35,684	2024/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31		国	債	証	券	0.7500	250			256		33,383	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47		国	債	証	券	1.3750	280			318		41,553	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26		国	債	証	券	0.5000	490			500		65,291	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34		国	債	証	券	1.1250	290			306		39,982	2034/04/15
FINLAND 1.5 04/15/23		国	債	証	券	1.5000	470			481		62,729	2023/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36		国	債	証	券	0.1250	260			238		31,114	2036/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25		国	債	証	券	4.0000	430			491		64,026	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28		国	債	証	券	2.7500	420			488		63,688	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42		国	債	証	券	2.6250	250			339		44,288	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29		国	債	証	券	0.5000	370			374		48,819	2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25		国	債	証	券	0.8750	330			341		44,573	2025/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28		国	債	証	券	0.5000	100			101		13,230	2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27		国	債	証	券	0.5000	500			510		66,608	2027/09/15
FINLAND 09/15/23		国	債	証	券	0.0000	280			282		36,810	2023/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40		国	債	証	券	0.2500	230			208		27,147	2040/09/15
FINLAND 0.125 09/15/31		国	債	証	券	0.1250	240			230		30,093	2031/09/15
FINLAND 0.0 09/15/30		国	債	証	券	0.0000	170			163		21,288	2030/09/15
FINLAND 0.0 09/15/24		国	債	証	券	0.0000	180			181		23,654	2024/09/15
小	計	—		—		6,020				6,268		817,158	—
(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	210			398		51,885	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47		国	債	証	券	1.5000	430			490		63,891	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29		国	債	証	券	0.5000	770			778		101,527	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28		国	債	証	券	0.7500	775			799		104,275	2028/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/31		国	債	証	券	0.0000	530			505		65,876	2031/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30		国	債	証	券	0.0000	690			666		86,824	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26		国	債	証	券	4.8500	740			890		116,106	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37		国	債	証	券	4.1500	890			1,328		173,218	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51		国	債	証	券	0.7500	290			274		35,831	2051/03/20
AUSTRIA 0.7 04/20/71		国	債	証	券	0.7000	250			203		26,524	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27		国	債	証	券	0.5000	650			664		86,564	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/23		国	債	証	券	0.0000	200			201		26,239	2023/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/25		国	債	証	券	0.0000	70			70		9,164	2025/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34		国	債	証	券	2.4000	680			821		107,048	2034/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20		国	債	証	券	0.8500	250			183		23,878	2120/06/30

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…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	470	695	90,658	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27		国 債 証 券	6.2500	670	894	116,617	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23		国 債 証 券	0.0000	650	654	85,320	2023/07/15
AUSTRIA 07/15/24		国 債 証 券	0.0000	800	806	105,126	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17		国 債 証 券	2.1000	350	469	61,196	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24		国 債 証 券	1.6500	450	473	61,744	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26		国 債 証 券	0.7500	480	495	64,647	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25		国 債 証 券	1.2000	640	670	87,454	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36		国 債 証 券	0.2500	140	128	16,772	2036/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23		国 債 証 券	1.7500	780	808	105,434	2023/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40		国 債 証 券	0.0000	300	254	33,233	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28		国 債 証 券	0.0000	190	186	24,248	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86		国 債 証 券	1.5000	150	165	21,628	2086/11/02
小 計		—	—	13,495	14,981	1,952,943	—
合 計		—	—	—	—	140,398,802	—

■投資信託財産の構成

2022年 2月21日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額		比 率
	千円		%
公 社 債	140,398,802		98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,603,315		1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	142,002,117		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、141,683,656千円、99.8％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、2022年 2月21日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝115.06円、1 カナダ・ドル＝90.31円、1 オーストラリア・ドル＝82.72円、1 シンガポール・ドル＝85.55円、1 イギリス・ポンド＝156.56円、1 イスラエル・シェケル＝35.899円、1 デンマーク・クローネ＝17.53円、1 ノルウェー・クローネ＝12.83円、1 スウェーデン・クローナ＝12.24円、1 メキシコ・ペソ＝5.678円、1 オフショア・人民元＝18.197円、1 マレーシア・リンギット＝27.471円、1 ポーランド・ズロチ＝28.774円、1 ユーロ＝130.36円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月21日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	142,002,117,999円
コ	ー ル ・ コ ー ン 等	794,768,295
公	社	140,398,802,240
未	収 利	769,298,727
前	払 費	39,248,737
(B) 負	債	37,199,000
未	払 解 約	37,199,000
(C) 純	資 産 総 額(A－B)	141,964,918,999
元	本	70,448,298,510
次	期 繰 越 損 益	71,516,620,489
(D) 受	益 権 総 口 数	70,448,298,510口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C／D)		20,152円

(注1) 期首元本額 69,085,269,493円
追加設定元本額 27,244,251,872円
一部解約元本額 25,881,222,855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	7,932,936,286円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	10,339,634円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	40,206,625円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	116,655,366円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	57,288,539円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	34,587,798円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,681,845円
たわらノーロード 先進国債券	13,393,825,381円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	237,469,433円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,697,389,145円
たわらノーロード バランス (堅実型)	48,164,130円
たわらノーロード バランス (標準型)	234,951,241円
たわらノーロード バランス (積極型)	48,864,225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)	6,482,910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)	328,688,088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)	382,425,252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)	74,160,647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)	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	364,777円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,078,910円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	26,244,851円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,149,968円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,109,913円
D I A M外国債券インデックスファンド<D C年金>	6,296,983,167円
O n e D C 先進国債券インデックスファンド	579,039,841円
O n e グローバルバランス	6,106,309円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>1安定型	711,700,267円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>2安定・成長型	2,226,508,317円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>3成長型	2,403,942,419円
D I A M D Cバランス30インデックスファンド	398,546,899円
D I A M D Cバランス50インデックスファンド	832,352,900円
D I A M D Cバランス70インデックスファンド	708,824,350円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	14,028,565円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	469,729,710円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	33,691,463円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	134,924,668円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	124,156,154円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	214,713,670円
クルーズコントロール	314,234,233円

D I A M 8資産バランスファンドN<D C年金>	154,405,852円
4資産分散投資・ハイクラス<D C年金>	340,795,660円
4資産分散投資・スタンダード<D C年金>	412,429,256円
9資産分散投資・スタンダード<D C年金>	180,716,406円
4資産分散投資・ミドルクラス<D C年金>	87,293,544円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,181,097,770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)	515,001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)	358,315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)	100,794,148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)	418,167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)	546,045円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ 2021-04 (適格機関投資家限定)	30,957,907円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	461,773,967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)	294,771円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	5,739,805,045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)	2,636,710,982円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,562,881,929円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,405,812,637円
D I A Mワールドバランス25V A (適格機関投資家限定)	53,529,486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)	645,235円
D I A Mグローバル・バランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	421,372,128円
D I A Mグローバル・バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	250,634,953円
D I A M国際分散/バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	17,641,800円
D I A M国際分散/バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	41,091,423円
D I A M国内重視/バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	8,714,858円
D I A M国内重視/バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	681,339円
D I A M世界/バランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	16,361,009円
D I A M世界/バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	48,455,016円
D I A Mバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	1,982,846,491円
D I A Mバランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定)	1,578,600,509円
D I A Mバランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	2,769,411,536円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家向け)	118,777,779円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	155,311,687円
D I A Mアクアグローバル/バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	1,842,758,601円
D I A M世界アセット/バランスファンドV A (適格機関投資家向け)	419,588,655円
D I A M世界/バランスファンド55V A (適格機関投資家限定)	3,247,697円
D I A M世界アセット/バランスファンド2V A (適格機関投資家限定)	357,842,695円
D I A M世界アセット/バランスファンド3V A (適格機関投資家限定)	352,697,590円
D I A M世界アセット/バランスファンド4V A (適格機関投資家限定)	479,890,739円
D I A M世界/バランス25V A (適格機関投資家限定)	57,398,790円
期末元本合計	70,448,298,510円

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収 益	2,669,252,055円
	受		取	利 息	2,669,419,651
	支		払	利 息	△167,596
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益				△631,639,253
	売		買	益	7,707,170,489
	売		買	損	△8,338,809,742
(C)	そ の 他 の 費 用				△18,689,995
(D)	当 期 損 益 金(A + B + C)				2,018,922,807
(E)	前 期 繰 越 損 益 金				67,952,264,861
(F)	解 約 差 損 益 金				△26,936,052,307
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金				28,481,485,128
(H)	合 計(D + E + F + G)				71,516,620,489
	次 期 繰 越 損 益 金(H)				71,516,620,489

(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。