

運用報告書（全体版）

第5期<決算日2024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、2024年3月25日に第5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

<https://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 イ ン ト (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
4 期 (2023年3月27日)	10,876	0	△2.2	126,444.21	△2.1	98.4	－	1,803
5 期 (2024年3月25日)	12,678	0	16.6	147,941.70	17.0	98.5	－	3,535

- (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)。

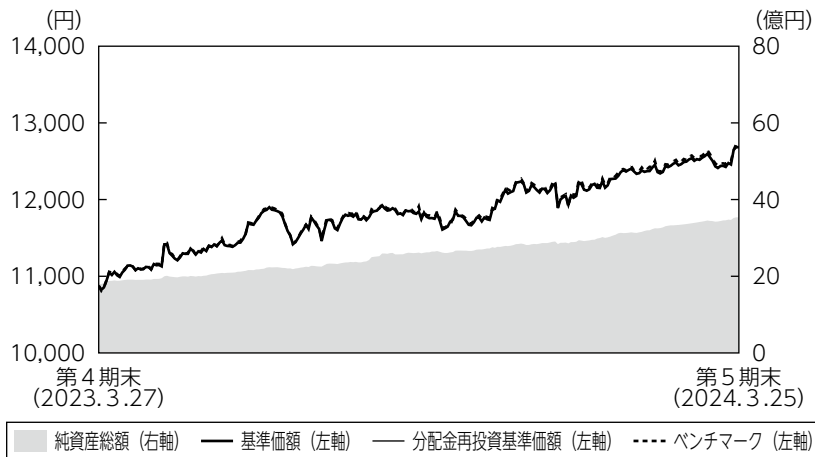
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2023 年 3 月 27 日	円 10,876	% —	ポイント 126,444.21	% —	% 98.4	% —
3 月 末	11,050	1.6	128,532.24	1.7	98.7	—
4 月 末	11,130	2.3	129,370.99	2.3	98.6	—
5 月 末	11,414	4.9	132,828.99	5.0	98.8	—
6 月 末	11,868	9.1	138,284.08	9.4	98.7	—
7 月 末	11,610	6.7	135,227.94	6.9	98.7	—
8 月 末	11,925	9.6	138,880.03	9.8	98.9	—
9 月 末	11,750	8.0	136,810.50	8.2	98.6	—
10 月 末	11,734	7.9	136,724.14	8.1	98.7	—
11 月 末	12,142	11.6	141,488.31	11.9	98.5	—
12 月 末	12,155	11.8	141,801.08	12.1	98.5	—
2024 年 1 月 末	12,370	13.7	144,118.59	14.0	99.4	—
2 月 末	12,527	15.2	146,060.66	15.5	98.5	—
(期 末) 2024 年 3 月 25 日	12,678	16.6	147,941.70	17.0	98.5	—

(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（2023年3月28日から2024年3月25日まで）

基準価額等の推移



第5期首：10,876円
第5期末：12,678円
(既払分配金0円)
騰落率：16.6%
(分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

インフレが長期化する中で、各国中央銀行による金融引き締め長期化観測から米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。米ドル／円相場は日米の金利差を受けて、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き円安ユーロ高となりました。債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことの寄与が大きかったことから、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、インフレが長期化する中でF R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを長期にわたり継続するという見方を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についても米国債の金利上昇やE C B（欧州中央銀行）の金融引き締めの長期化観測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に、ユーロ／円相場は円安ユーロ高となりました。主要国で金融引き締めが長期化すると見られる一方で、日銀が緩和的な金融政策を継続していることで日米の金利差が意識され円安米ドル高に推移しました。ユーロ／円相場についても、同様に中央銀行の金融政策の違い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。

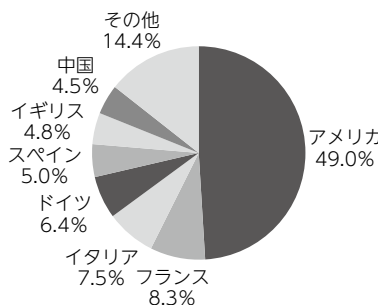
●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

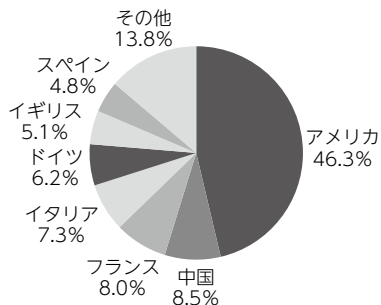
【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】

○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。

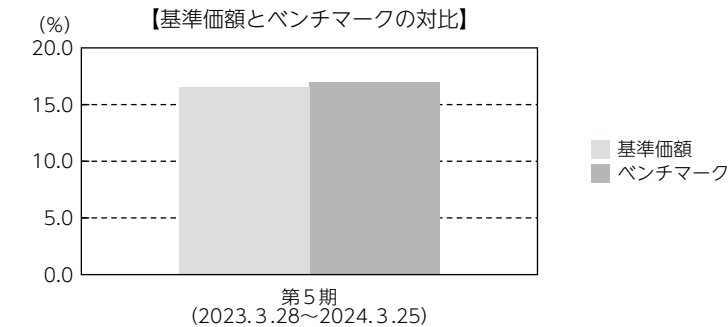
（注2）現金等はその他として表示しています。

（注3）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17.0%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.4%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
	2023年3月28日 ～2024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	2,678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5期		項目の概要
	(2023年3月28日 ～2024年3月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	18円	0.153%	(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11,838円です。
（投信会社）	(8)	(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）	(8)	(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）	(3)	(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	0.019	(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）	(2)	(0.015)	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	20	0.172	

(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。

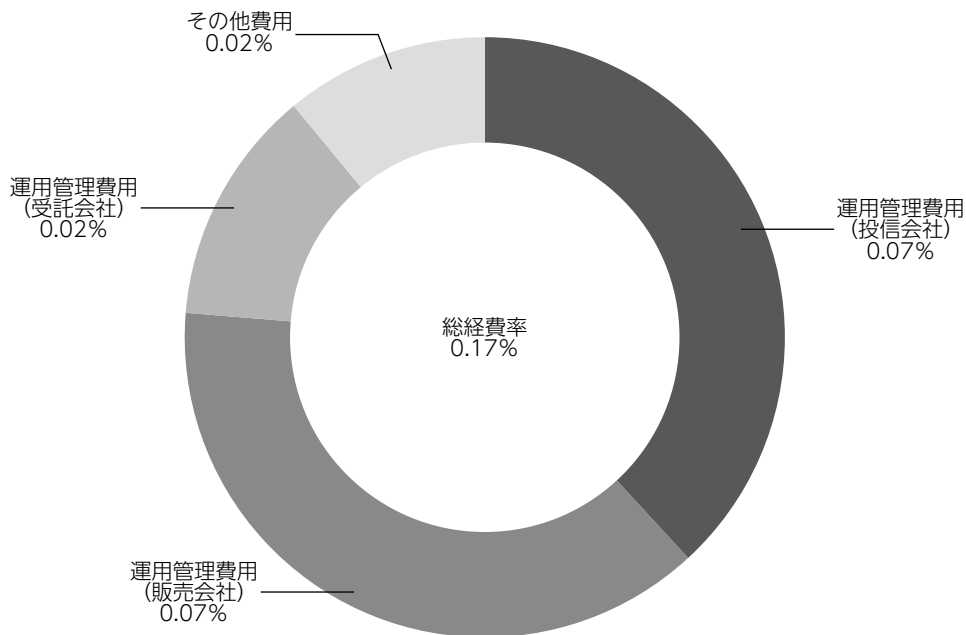
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2023年3月28日から2024年3月25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	688,117	1,520,967	81,606	179,792

■利害関係人との取引状況等（2023年3月28日から2024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。

■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	893,168	1,499,678	3,535,792

■投資信託財産の構成

2024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	3,535,792	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,751	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	3,544,543	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、2024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258,634,176千円、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、2024年3月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=151.43円、1カナダ・ドル=111.22円、1オーストラリア・ドル=98.64円、1シンガポール・ドル=112.20円、1ニュージーランド・ドル=90.75円、1イギリス・ポンド=190.71円、1イスラエル・シケル=41.64円、1デンマーク・クローネ=21.94円、1ノルウェー・クローネ=14.07円、1スウェーデン・クローナ=14.33円、1メキシコ・ペソ=9.04円、1オファショア・人民元=20.813円、1マレーシア・リンギット=31.944円、1ポーランド・ズロチ=37.848円、1ユーロ=163.60円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年 3月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,544,543,835円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,751,414
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	3,535,792,421
(B) 負 債	8,616,841
未 払 解 約 金	6,283,145
未 払 信 託 報 酬	2,280,202
そ の 他 未 払 費 用	53,494
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	3,535,926,994
元 本	2,789,004,654
次 期 繰 越 損 益 金	746,922,340
(D) 受 益 権 総 口 数	2,789,004,654口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C／D)	12,678円

- (注) 期首における元本額は1,658,447,400円、当期中における追加設定元本額は1,712,692,476円、同解約元本額は582,135,222円です。

■損益の状況

当期 自2023年 3月28日 至2024年 3月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,190円
受 取 利 息	320
支 払 利 息	△1,510
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	343,615,554
売 買 益	390,024,840
売 買 損	△46,409,286
(C) 信 託 報 酬 等	△4,071,253
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	339,543,111
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△15,877,231
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	423,256,460
(配 当 等 相 当 額)	(198,072,920)
(売 買 損 益 相 当 額)	(225,183,540)
(G) 合 計(D＋E＋F)	746,922,340
次 期 繰 越 損 益 金(G)	746,922,340
追 加 信 託 差 損 益 金	423,256,460
(配 当 等 相 当 額)	(199,567,138)
(売 買 損 益 相 当 額)	(223,689,322)
分 配 準 備 積 立 金	323,665,880

- (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	62,280,083円
(b) 経 費 控 除 後 の 有 価 証 券 売 買 等 損 益	224,661,970
(c) 収 益 調 整 金	423,256,460
(d) 分 配 準 備 積 立 金	36,723,827
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a＋b＋c＋d)	746,922,340
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	2,678.10
(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21期（決算日 2024年2月21日）

（計算期間 2023年2月22日～2024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21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			
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
20期 (2023年2月21日)	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	—	186,822
21期 (2024年2月21日)	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	—	260,393

(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）。

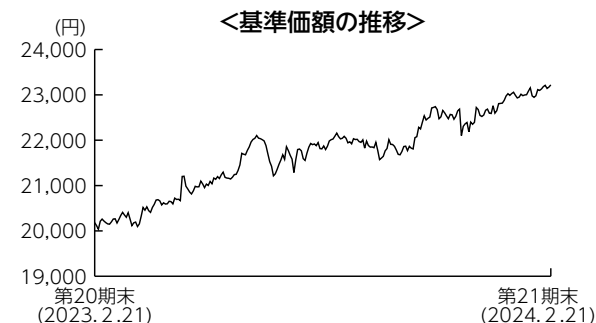
(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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) 2023 年 2 月 21 日	円 20,182	% —	ポイント 126,494.96	% —	% 99.0	% —
2 月 末	20,261	0.4	126,903.56	0.3	98.9	—
3 月 末	20,517	1.7	128,532.24	1.6	98.7	—
4 月 末	20,668	2.4	129,370.99	2.3	98.6	—
5 月 末	21,198	5.0	132,828.99	5.0	98.8	—
6 月 末	22,045	9.2	138,284.08	9.3	98.7	—
7 月 末	21,569	6.9	135,227.94	6.9	98.7	—
8 月 末	22,157	9.8	138,880.03	9.8	98.9	—
9 月 末	21,834	8.2	136,810.50	8.2	98.6	—
10 月 末	21,807	8.1	136,724.14	8.1	98.7	—
11 月 末	22,569	11.8	141,488.31	11.9	98.5	—
12 月 末	22,596	12.0	141,801.08	12.1	98.5	—
2024 年 1 月 末	22,998	14.0	144,118.59	13.9	99.4	—
(期 末) 2024 年 2 月 21 日	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	—

(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（2023年2月22日から2024年2月21日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は23,220円となり、前期末比で15.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは、上昇（価格は下落）しました。米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下（価格は上昇）したのち、金融引き締め of 長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドル／円については日銀が金融緩和を継続する中、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを継続したことを受け、日米金利差が意識され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、米国債利回りは上昇、ドイツ債の利回りは低下しました。米国債は、米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下したのち、金融引き締め of 長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドイツ債については、金融引き締め of 長期化観測が高まり上昇したのちに、ユーロ圏の景気懸念やインフレの鈍化などから利回りは低下しました。

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 R Bが金融引き締めを継続する中、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

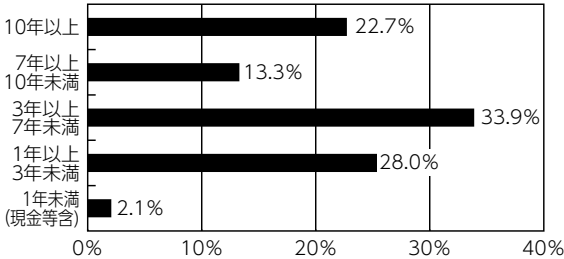
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

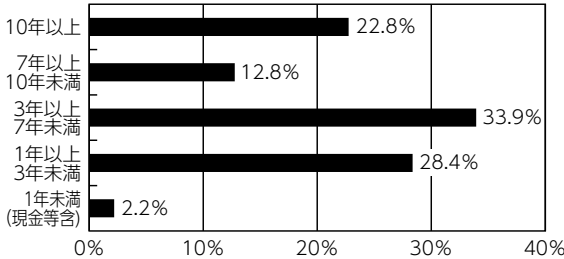
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

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

期末

国		当ファンド	世界国債インデックス	差
北米	米国	46.7%	47.2%	△0.5%
	カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
	計	48.7%	49.2%	△0.5%
中南米	メキシコ	0.8%	0.9%	△0.0%
	計	0.8%	0.9%	△0.0%
欧州	オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
	ベルギー	1.7%	1.8%	△0.0%
	フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
	フランス	8.0%	8.1%	△0.1%
	ドイツ	6.3%	6.3%	△0.0%
	アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
	イタリア	7.3%	7.3%	△0.1%
	オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
	スペイン	4.8%	4.9%	△0.1%
	ユーロ計	31.8%	32.1%	△0.3%
	デンマーク	0.3%	0.3%	△0.0%
	スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
	英国	5.2%	5.2%	△0.1%
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%	0.2%	△0.0%
	計	38.1%	38.5%	△0.4%
	オーストラリア	1.3%	1.4%	△0.0%
	ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
	中国	8.3%	8.5%	△0.2%
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	10.7%	11.0%	△0.3%
	イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
	計	0.3%	0.3%	△0.0%
	現金など	1.3%	—	—
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15.1%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマークと同程度となり、概ねベンチマークに連動した結果となりました。

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	0.015%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保 管 費 用)	(3)	(0.014)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	3	0.015	
期中の平均基準価額は21,728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（2023年2月22日から2024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 459,048	千アメリカ・ドル 331,987
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 25,463	千カナダ・ドル 17,904
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 16,897	千オーストラリア・ドル 13,157
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 3,224	千シンガポール・ドル 2,464
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 2,597	千ニュージーランド・ドル 989
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 40,138	千イギリス・ポンド 22,621
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シュケル 7,410	千イスラエル・シュケル 3,549
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 11,286	千デンマーク・クローネ 12,347
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 13,227	千ノルウェー・クローネ 10,083
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 9,524	千スウェーデン・クローナ 2,541
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 113,030	千メキシコ・ペソ 81,670
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 730,187	千オフショア・人民元 137,577
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 11,910	千マレーシア・リンギット 7,301
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 16,614	千ポーランド・ズロチ 10,609
国	ユーロ圏	アイルランド	千ユーロ 3,525	千ユーロ 2,887
		オランダ	11,284	8,015
		ベルギー	12,412	9,503
		フランス	70,879	54,149
		ドイツ	54,900	40,085
		スペイン	40,842	30,090
		イタリア	62,054	47,199
		フィンランド	3,929	2,451
		オーストラリア	10,493	7,197

（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（2023年2月22日から2024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 916,450	千アメリカ・ドル 810,479	千円 121,701,636	% 46.7	% －	% 19.6	% 19.4	% 7.8
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 50,260	千カナダ・ドル 46,076	千円 5,115,401	2.0	－	1.1	0.5	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 40,065	千オーストラリア・ドル 35,489	千円 3,492,489	1.3	－	0.9	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 9,855	千シンガポール・ドル 9,323	千円 1,041,728	0.4	－	0.3	0.1	0.0
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 7,570	千ニュージーランド・ドル 6,419	千円 594,617	0.2	－	0.1	0.1	0.0
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 86,324	千イギリス・ポンド 70,878	千円 13,437,202	5.2	－	3.5	1.1	0.6
イスラエル	千イスラエル・シェケル 22,320	千イスラエル・シェケル 19,889	千円 810,730	0.3	－	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 32,720	千デンマーク・クローネ 30,676	千円 668,129	0.3	－	0.2	0.0	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32,620	千ノルウェー・クローネ 29,940	千円 429,040	0.2	－	0.1	0.0	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 37,140	千スウェーデン・クローナ 35,693	千円 517,914	0.2	－	0.1	0.1	0.0
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 273,005	千メキシコ・ペソ 250,053	千円 2,201,447	0.8	－	0.5	0.3	0.0
中 国	千オフショア・人民元 1,000,520	千オフショア・人民元 1,032,940	千円 21,528,239	8.3	－	3.7	3.7	0.8
マレーシア	千マレーシア・リンギット 38,060	千マレーシア・リンギット 38,987	千円 1,219,734	0.5	－	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 39,150	千ポーランド・ズロチ 35,744	千円 1,344,336	0.5	－	0.2	0.3	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	10,200	9,105	1,478,204	0.6	－	0.4	0.1	0.0
オランダ	25,700	23,264	3,776,775	1.5	－	0.8	0.5	0.1
ベルギー	30,390	27,580	4,477,411	1.7	－	1.2	0.5	0.1
フランス	141,120	128,977	20,938,250	8.0	－	4.8	2.6	0.6
ドイツ	108,580	100,614	16,333,748	6.3	－	3.3	2.1	0.8
スペイン	82,390	77,154	12,525,285	4.8	－	2.7	1.6	0.6
イタリア	122,640	116,425	18,900,577	7.3	－	4.1	2.5	0.7
フィンランド	9,630	8,170	1,326,408	0.5	－	0.3	0.1	0.1
オーストリア	21,230	18,965	3,078,798	1.2	－	0.6	0.5	0.1
合 計	－	－	千円 256,938,107	98.7	－	48.9	36.6	13.1

(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	2,460	2,371	356,089	2026/01/31							
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	5,740	5,288	794,126	2027/01/31							
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	4,000	600,691	2029/01/31							
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	725	108,912	2025/01/31							
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,819	573,587	2028/01/31							
US T N/B 4.125 01/31/25	国債証券	4.1250	1,800	1,785	268,146	2025/01/31							
US T N/B 3.5 01/31/30	国債証券	3.5000	3,400	3,261	489,813	2030/01/31							
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	5,700	5,256	789,361	2026/01/31							
US T N/B 3.5 01/31/28	国債証券	3.5000	2,380	2,310	346,875	2028/01/31							
US T N/B 4.0 01/15/27	国債証券	4.0000	3,000	2,968	445,728	2027/01/15							
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	4,300	4,243	637,175	2026/01/15							
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	2,400	2,464	370,083	2026/02/15							
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,360	1,120	168,216	2042/02/15							
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,540	1,255	188,501	2043/02/15							
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,370	973	146,217	2046/02/15							
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	1,000	903	135,633	2039/02/15							
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,860	1,992	299,197	2031/02/15							
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	500	515	77,347	2036/02/15							
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,230	1,267	190,255	2041/02/15							
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,424	213,888	2044/02/15							
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	4,610	3,530	530,129	2049/02/15							
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	5,000	3,219	483,415	2052/02/15							
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	603	90,611	2038/02/15							
US T N/B 3.625 02/15/53	国債証券	3.6250	3,800	3,277	492,149	2053/02/15							
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	1,690	1,723	258,845	2040/02/15							
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,636	395,854	2042/02/15							
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	5,780	3,405	511,431	2051/02/15							
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	6,090	5,751	863,678	2026/02/15							
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,810	2,020	303,350	2045/02/15							
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	2,360	1,825	274,185	2047/02/15							
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,037	306,020	2048/02/15							
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,981	297,545	2025/02/15							
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,830	4,477	672,407	2029/02/15							
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,540	4,283	643,206	2028/02/15							
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,556	534,113	2027/02/15							
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,189	328,837	2026/02/28							
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,917	287,912	2025/02/28							
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	9,690	7,896	1,185,695	2031/02/15							
US T N/B 3.875 02/15/43	国債証券	3.8750	3,500	3,186	478,547	2043/02/15							
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	5,100	3,485	523,327	2041/02/15							
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	4,420	2,712	407,376	2050/02/15							
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	8,280	6,939	1,041,964	2032/02/15							
US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	3.5000	7,900	7,436	1,116,617	2033/02/15							
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,000	150,171	2027/02/28							
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	4,830	4,128	619,966	2030/02/15							
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	5,210	4,844	727,417	2027/02/28							
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,867	430,577	2025/02/28							
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	4,690	4,143	622,257	2028/02/29							

銘	柄	当			期		末	
		種	類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
(アメリカ)				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.875 02/28/29		国	債 証 券	1.8750	4,700	4,196	630,186	2029/02/28
US T N/B 0.5 02/28/26		国	債 証 券	0.5000	5,170	4,766	715,767	2026/02/28
US T N/B 1.5 02/15/25		国	債 証 券	1.5000	4,550	4,397	660,307	2025/02/15
US T N/B 4.0 02/28/30		国	債 証 券	4.0000	3,000	2,955	443,775	2030/02/28
US T N/B 4.0 02/29/28		国	債 証 券	4.0000	3,200	3,163	474,993	2028/02/29
US T N/B 4.0 02/15/26		国	債 証 券	4.0000	4,000	3,956	594,070	2026/02/15
US T N/B 2.625 03/31/25		国	債 証 券	2.6250	1,790	1,746	262,297	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26		国	債 証 券	2.2500	3,300	3,150	473,093	2026/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27		国	債 証 券	0.6250	3,200	2,856	428,894	2027/03/31
US T N/B 0.5 03/31/25		国	債 証 券	0.5000	2,860	2,726	409,343	2025/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28		国	債 証 券	1.2500	4,610	4,084	613,360	2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26		国	債 証 券	0.7500	5,720	5,290	794,463	2026/03/31
US T N/B 2.375 03/31/29		国	債 証 券	2.3750	4,000	3,655	548,928	2029/03/31
US T N/B 2.5 03/31/27		国	債 証 券	2.5000	4,000	3,786	568,508	2027/03/31
US T N/B 3.625 03/31/30		国	債 証 券	3.6250	3,300	3,183	478,087	2030/03/31
US T N/B 1.75 03/15/25		国	債 証 券	1.7500	4,000	3,868	580,908	2025/03/15
US T N/B 3.625 03/31/28		国	債 証 券	3.6250	3,800	3,703	556,131	2028/03/31
US T N/B 4.625 03/15/26		国	債 証 券	4.6250	3,630	3,634	545,751	2026/03/15
US T N/B 3.875 03/31/25		国	債 証 券	3.8750	1,050	1,038	155,949	2025/03/31
US T N/B 2.875 04/30/25		国	債 証 券	2.8750	2,000	1,954	293,521	2025/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26		国	債 証 券	2.3750	2,060	1,968	295,603	2026/04/30
US T N/B 1.25 04/30/28		国	債 証 券	1.2500	5,100	4,508	677,014	2028/04/30
US T N/B 0.5 04/30/27		国	債 証 券	0.5000	2,370	2,100	315,397	2027/04/30
US T N/B 2.875 04/30/29		国	債 証 券	2.8750	3,800	3,555	533,875	2029/04/30
US T N/B 0.75 04/30/26		国	債 証 券	0.7500	6,000	5,533	830,889	2026/04/30
US T N/B 3.5 04/30/28		国	債 証 券	3.5000	3,100	3,005	451,331	2028/04/30
US T N/B 0.375 04/30/25		国	債 証 券	0.3750	2,560	2,428	364,723	2025/04/30
US T N/B 2.75 04/30/27		国	債 証 券	2.7500	6,000	5,713	857,953	2027/04/30
US T N/B 3.5 04/30/30		国	債 証 券	3.5000	3,000	2,873	431,413	2030/04/30
US T N/B 3.75 04/15/26		国	債 証 券	3.7500	6,000	5,904	886,600	2026/04/15
US T N/B 2.625 04/15/25		国	債 証 券	2.6250	3,000	2,925	439,288	2025/04/15
US T N/B 6.25 05/15/30		国	債 証 券	6.2500	759	839	126,116	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40		国	債 証 券	4.3750	1,210	1,197	179,777	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41		国	債 証 券	4.3750	1,630	1,601	240,549	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42		国	債 証 券	3.0000	1,080	869	130,615	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39		国	債 証 券	4.2500	950	933	140,155	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43		国	債 証 券	2.8750	2,290	1,790	268,860	2043/05/15
US T N/B 2.375 05/15/51		国	債 証 券	2.3750	5,560	3,696	555,136	2051/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44		国	債 証 券	3.3750	1,430	1,201	180,401	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45		国	債 証 券	3.0000	1,290	1,011	151,893	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47		国	債 証 券	3.0000	1,620	1,251	187,879	2047/05/15
US T N/B 2.875 05/15/52		国	債 証 券	2.8750	4,510	3,346	502,453	2052/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46		国	債 証 券	2.5000	1,730	1,226	184,132	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48		国	債 証 券	3.1250	2,830	2,224	334,027	2048/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40		国	債 証 券	1.1250	3,300	2,015	302,659	2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49		国	債 証 券	2.8750	4,600	3,435	515,839	2049/05/15
US T N/B 3.625 05/15/53		国	債 証 券	3.6250	3,510	3,029	454,981	2053/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38		国	債 証 券	4.5000	600	609	91,556	2038/05/15
US T N/B 2.25 05/15/41		国	債 証 券	2.2500	4,420	3,201	480,734	2041/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25		国	債 証 券	2.1250	3,950	3,823	574,086	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28		国	債 証 券	2.8750	4,860	4,594	689,924	2028/05/15

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 価 額		償還年月日
				外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額		
				千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)	国 債 証 券	%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.375 05/15/29	国 債 証 券	2.3750	3,770	3,439	516,436	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国 債 証 券	2.3750	4,430	4,166	625,673	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国 債 証 券	5.0000	755	810	121,723	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国 債 証 券	1.6250	5,170	4,856	729,232	2026/05/15
US T N/B 1.25 05/15/50	国 債 証 券	1.2500	8,380	4,185	628,531	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国 債 証 券	2.1250	2,250	2,135	320,676	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国 債 証 券	1.6250	8,740	7,316	1,098,697	2031/05/15
US T N/B 2.875 05/31/25	国 債 証 券	2.8750	1,570	1,532	230,147	2025/05/31
US T N/B 3.25 05/15/42	国 債 証 券	3.2500	3,760	3,143	472,092	2042/05/15
US T N/B 3.875 05/15/43	国 債 証 券	3.8750	800	728	109,316	2043/05/15
US T N/B 2.875 05/15/32	国 債 証 券	2.8750	8,050	7,264	1,090,860	2032/05/15
US T N/B 3.375 05/15/33	国 債 証 券	3.3750	7,500	6,979	1,048,025	2033/05/15
US T N/B 0.5 05/31/27	国 債 証 券	0.5000	2,980	2,632	395,230	2027/05/31
US T N/B 1.25 05/31/28	国 債 証 券	1.2500	4,140	3,652	548,447	2028/05/31
US T N/B 0.625 05/15/30	国 債 証 券	0.6250	7,050	5,653	848,990	2030/05/15
US T N/B 2.625 05/31/27	国 債 証 券	2.6250	4,910	4,651	698,405	2027/05/31
US T N/B 2.75 05/31/29	国 債 証 券	2.7500	3,300	3,065	460,240	2029/05/31
US T N/B 0.75 05/31/26	国 債 証 券	0.7500	5,630	5,177	777,521	2026/05/31
US T N/B 3.625 05/31/28	国 債 証 券	3.6250	2,500	2,435	365,721	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国 債 証 券	0.2500	1,690	1,595	239,555	2025/05/31
US T N/B 3.75 05/31/30	国 債 証 券	3.7500	3,500	3,397	510,121	2030/05/31
US T N/B 3.625 05/15/26	国 債 証 券	3.6250	3,500	3,434	515,746	2026/05/15
US T N/B 2.75 05/15/25	国 債 証 券	2.7500	2,200	2,145	322,144	2025/05/15
US T N/B 2.75 06/30/25	国 債 証 券	2.7500	1,040	1,012	152,073	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国 債 証 券	1.8750	2,880	2,715	407,729	2026/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国 債 証 券	0.5000	2,780	2,448	367,718	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国 債 証 券	1.2500	3,710	3,265	490,340	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国 債 証 券	0.2500	3,500	3,293	494,529	2025/06/30
US T N/B 3.25 06/30/27	国 債 証 券	3.2500	4,200	4,057	609,214	2027/06/30
US T N/B 0.875 06/30/26	国 債 証 券	0.8750	4,510	4,152	623,586	2026/06/30
US T N/B 3.25 06/30/29	国 債 証 券	3.2500	3,500	3,329	500,000	2029/06/30
US T N/B 2.875 06/15/25	国 債 証 券	2.8750	2,420	2,361	354,536	2025/06/15
US T N/B 4.0 06/30/28	国 債 証 券	4.0000	2,000	1,977	296,906	2028/06/30
US T N/B 4.125 06/15/26	国 債 証 券	4.1250	4,700	4,661	700,031	2026/06/15
US T N/B 3.75 06/30/30	国 債 証 券	3.7500	5,700	5,531	830,535	2030/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国 債 証 券	2.8750	2,200	2,143	321,828	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国 債 証 券	1.8750	2,500	2,352	353,183	2026/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国 債 証 券	1.0000	9,270	8,049	1,208,687	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国 債 証 券	0.3750	3,780	3,304	496,221	2027/07/31
US T N/B 4.0 07/31/30	国 債 証 券	4.0000	2,500	2,459	369,343	2030/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国 債 証 券	0.2500	3,800	3,563	535,067	2025/07/31
US T N/B 2.625 07/31/29	国 債 証 券	2.6250	3,070	2,827	424,508	2029/07/31
US T N/B 4.125 07/31/28	国 債 証 券	4.1250	2,500	2,484	373,061	2028/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国 債 証 券	0.6250	5,100	4,651	698,507	2026/07/31
US T N/B 2.75 07/31/27	国 債 証 券	2.7500	3,820	3,625	544,426	2027/07/31
US T N/B 3.0 07/15/25	国 債 証 券	3.0000	3,200	3,124	469,137	2025/07/15
US T N/B 4.5 07/15/26	国 債 証 券	4.5000	4,100	4,102	615,956	2026/07/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国 債 証 券	3.7500	1,220	1,105	165,966	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国 債 証 券	3.8750	1,290	1,198	179,897	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国 債 証 券	2.7500	1,240	957	143,852	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国 債 証 券	3.1250	2,090	1,684	252,930	2044/08/15

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 4.5 08/15/39	国 債 証 券	4.5000	1,480	1,492	224,181	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国 債 証 券	3.6250	1,470	1,287	193,397	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国 債 証 券	2.0000	5,810	3,522	528,927	2051/08/15
US T N/B 4.125 08/15/53	国 債 証 券	4.1250	1,600	1,512	227,173	2053/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国 債 証 券	2.8750	1,770	1,355	203,495	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国 債 証 券	2.0000	3,550	3,411	512,338	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国 債 証 券	2.7500	2,230	1,640	246,263	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国 債 証 券	2.2500	4,140	2,705	406,314	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国 債 証 券	3.0000	5,540	4,220	633,695	2052/08/15
US T N/B 4.375 08/15/43	国 債 証 券	4.3750	2,000	1,948	292,647	2043/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国 債 証 券	2.2500	2,270	1,526	229,150	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国 債 証 券	3.0000	3,810	2,922	438,881	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国 債 証 券	2.2500	4,240	3,955	593,938	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国 債 証 券	1.5000	7,030	6,545	982,844	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国 債 証 券	2.8750	5,030	4,742	712,199	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国 債 証 券	2.7500	1,830	1,777	266,844	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国 債 証 券	1.6250	3,360	2,938	441,214	2029/08/15
US T N/B 3.375 08/15/42	国 債 証 券	3.3750	2,920	2,482	372,739	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国 債 証 券	1.7500	5,310	3,510	527,153	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国 債 証 券	1.1250	4,060	2,456	368,814	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国 債 証 券	1.3750	6,870	3,546	532,522	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国 債 証 券	2.7500	7,840	6,984	1,048,768	2032/08/15
US T N/B 3.875 08/15/33	国 債 証 券	3.8750	8,000	7,742	1,162,613	2033/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国 債 証 券	1.2500	8,960	7,241	1,087,383	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国 債 証 券	0.6250	7,740	6,153	923,979	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国 債 証 券	1.3750	2,800	2,596	389,899	2026/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国 債 証 券	0.2500	3,590	3,354	503,781	2025/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28	国 債 証 券	1.1250	3,730	3,249	488,017	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国 債 証 券	0.5000	3,060	2,680	402,439	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国 債 証 券	0.7500	4,950	4,517	678,384	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国 債 証 券	3.1250	3,030	2,960	444,578	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国 債 証 券	3.1250	3,110	2,935	440,838	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国 債 証 券	3.1250	3,940	3,783	568,138	2027/08/31
US T N/B 4.375 08/15/26	国 債 証 券	4.3750	4,000	3,991	599,431	2026/08/15
US T N/B 3.0 09/30/25	国 債 証 券	3.0000	1,750	1,703	255,861	2025/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国 債 証 券	0.3750	3,810	3,312	497,388	2027/09/30
US T N/B 4.625 09/30/30	国 債 証 券	4.6250	3,000	3,057	459,067	2030/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国 債 証 券	1.6250	1,550	1,444	216,919	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国 債 証 券	1.2500	4,980	4,354	653,898	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国 債 証 券	0.2500	3,720	3,465	520,399	2025/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国 債 証 券	4.1250	3,220	3,197	480,106	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国 債 証 券	0.8750	5,510	5,036	756,246	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国 債 証 券	3.5000	3,000	2,944	442,183	2025/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国 債 証 券	3.8750	4,550	4,459	669,563	2029/09/30
US T N/B 4.625 09/15/26	国 債 証 券	4.6250	3,500	3,514	527,756	2026/09/15
US T N/B 3.0 10/31/25	国 債 証 券	3.0000	2,270	2,208	331,602	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国 債 証 券	1.6250	2,410	2,240	336,454	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国 債 証 券	1.3750	4,710	4,134	620,794	2028/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国 債 証 券	0.5000	3,660	3,187	478,590	2027/10/31
US T N/B 1.125 10/31/26	国 債 証 券	1.1250	4,490	4,118	618,411	2026/10/31
US T N/B 4.0 10/31/29	国 債 証 券	4.0000	2,700	2,662	399,730	2029/10/31

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			
(アメリカ)					%	千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル	千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル	千	円					
US T N/B 4.125 10/31/27		国	債	証	券	4.1250							3,340									3,315					497,919	2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25		国	債	証	券	0.2500							4,000									3,714					557,809	2025/10/31
US T N/B 4.625 10/15/26		国	債	証	券	4.6250							3,400									3,415					512,877	2026/10/15
US T N/B 4.25 10/15/25		国	債	証	券	4.2500							4,000									3,972					596,451	2025/10/15
US T N/B 5.25 11/15/28		国	債	証	券	5.2500							1,350									1,406					211,165	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27		国	債	証	券	6.1250							2,200									2,334					350,598	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44		国	債	証	券	3.0000							1,960									1,543					231,777	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40		国	債	証	券	4.2500							1,300									1,261					189,496	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42		国	債	証	券	2.7500							1,556									1,197					179,882	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41		国	債	証	券	3.1250							1,020									843					126,592	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43		国	債	証	券	3.7500							1,460									1,300					195,336	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47		国	債	証	券	2.7500							2,250									1,652					248,089	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50		国	債	証	券	1.6250							5,280									2,917					438,077	2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51		国	債	証	券	1.8750							5,370									3,146					472,444	2051/11/15
US T N/B 4.0 11/15/52		国	債	証	券	4.0000							4,860									4,492					674,588	2052/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45		国	債	証	券	3.0000							460									359					53,947	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46		国	債	証	券	2.8750							1,080									818					122,902	2046/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39		国	債	証	券	4.3750							1,000									992					149,086	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48		国	債	証	券	3.3750							3,450									2,834					425,581	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49		国	債	証	券	2.3750							3,690									2,478					372,127	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25		国	債	証	券	2.2500							5,120									4,916					738,276	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28		国	債	証	券	3.1250							5,480									5,213					782,857	2028/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26		国	債	証	券	2.0000							7,830									7,347				1,103,278	2026/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27		国	債	証	券	2.2500							3,270									3,038					456,239	2027/11/15
US T N/B 2.875 11/30/25		国	債	証	券	2.8750							3,360									3,259					489,371	2025/11/30
US T N/B 4.0 11/15/42		国	債	証	券	4.0000							3,120									2,895					434,789	2042/11/15
US T N/B 1.375 11/15/40		国	債	証	券	1.3750							4,320									2,717					408,105	2040/11/15
US T N/B 4.75 11/15/43		国	債	証	券	4.7500							500									512					76,927	2043/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41		国	債	証	券	2.0000							4,250									2,923					438,985	2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26		国	債	証	券	1.6250							1,810									1,680					252,318	2026/11/30
US T N/B 4.125 11/15/32		国	債	証	券	4.1250							7,600									7,507				1,127,285	2032/11/15	
US T N/B 1.75 11/15/29		国	債	証	券	1.7500							2,850									2,497					375,063	2029/11/15
US T N/B 4.5 11/15/33		国	債	証	券	4.5000							2,000									2,033					305,294	2033/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31		国	債	証	券	1.3750							8,590									6,959					1,044,999	2031/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30		国	債	証	券	0.8750							9,480									7,624				1,144,902	2030/11/15	
US T N/B 0.625 11/30/27		国	債	証	券	0.6250							3,900									3,403					511,082	2027/11/30
US T N/B 1.25 11/30/26		国	債	証	券	1.2500							4,700									4,317					648,244	2026/11/30
US T N/B 1.5 11/30/28		国	債	証	券	1.5000							5,000									4,406					661,701	2028/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25		国	債	証	券	0.3750							5,190									4,815					723,118	2025/11/30
US T N/B 3.875 11/30/29		国	債	証	券	3.8750							2,800									2,742					411,825	2029/11/30
US T N/B 3.875 11/30/27		国	債	証	券	3.8750							3,300									3,248					487,727	2027/11/30
US T N/B 4.5 11/15/25		国	債	証	券	4.5000							3,570									3,559					534,542	2025/11/15
US T N/B 4.625 11/15/26		国	債	証	券	4.6250							3,900									3,919					588,620	2026/11/15
US T N/B 2.625 12/31/25		国	債	証	券	2.6250							3,000									2,894					434,704	2025/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26		国	債	証	券	1.7500							2,110									1,962					294,640	2026/12/31
US T N/B 1.25 12/31/26		国	債	証	券	1.2500							3,890									3,566					535,578	2026/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28		国	債	証	券	1.3750							4,600									4,022					603,948	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25		国	債	証	券	0.3750							4,000									3,701					555,861	2025/12/31
US T N/B 3.875 12/31/29		国	債	証	券	3.8750							2,800									2,741					411,628	2029/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27		国	債	証	券	0.6250							4,020									3,497					525,216	2027/12/31
US T N/B 4.375 12/15/26		国	債	証	券	4.3750							4,800									4,796					720,289	2026/12/15

銘	柄	当		期			末							
		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 4.0 12/15/25		国	債	証	券	4.0000	4,140	4,093	614,692					2025/12/15
US T N/B 3.875 12/31/27		国	債	証	券	3.8750	4,600	4,527	679,794					2027/12/31
小計		—		—		916,450	810,479	121,701,636	—					
(カナダ)					%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円						
CANADA 3.75 02/01/25		国	債	証	券	3.7500	1,160	1,150	127,675					2025/02/01
CANADA 1.25 03/01/25		国	債	証	券	1.2500	700	676	75,148					2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26		国	債	証	券	0.2500	1,410	1,306	145,062					2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27		国	債	証	券	1.2500	910	844	93,769					2027/03/01
CANADA 3.5 03/01/28		国	債	証	券	3.5000	1,630	1,619	179,792					2028/03/01
CANADA 3.0 04/01/26		国	債	証	券	3.0000	1,400	1,370	152,122					2026/04/01
CANADA 1.5 04/01/25		国	債	証	券	1.5000	1,100	1,063	118,083					2025/04/01
CANADA 1.5 06/01/26		国	債	証	券	1.5000	1,700	1,608	178,594					2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29		国	債	証	券	5.7500	740	818	90,862					2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33		国	債	証	券	5.7500	610	716	79,595					2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37		国	債	証	券	5.0000	630	728	80,894					2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41		国	債	証	券	4.0000	740	790	87,730					2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28		国	債	証	券	2.0000	930	871	96,783					2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25		国	債	証	券	2.2500	1,320	1,283	142,538					2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27		国	債	証	券	1.0000	550	504	56,015					2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29		国	債	証	券	2.2500	530	498	55,311					2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30		国	債	証	券	1.2500	2,350	2,051	227,786					2030/06/01
CANADA 2.75 06/01/33		国	債	証	券	2.7500	1,180	1,109	123,221					2033/06/01
CANADA 1.5 06/01/31		国	債	証	券	1.5000	2,470	2,151	238,845					2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32		国	債	証	券	2.0000	1,590	1,417	157,375					2032/06/01
CANADA 3.5 08/01/25		国	債	証	券	3.5000	400	394	43,835					2025/08/01
CANADA 0.5 09/01/25		国	債	証	券	0.5000	2,310	2,180	242,092					2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27		国	債	証	券	2.7500	1,050	1,015	112,775					2027/09/01
CANADA 1.0 09/01/26		国	債	証	券	1.0000	2,670	2,484	275,819					2026/09/01
CANADA 3.25 09/01/28		国	債	証	券	3.2500	1,200	1,181	131,149					2028/09/01
CANADA 3.0 10/01/25		国	債	証	券	3.0000	1,660	1,625	180,456					2025/10/01
CANADA 3.5 12/01/45		国	債	証	券	3.5000	800	806	89,588					2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48		国	債	証	券	2.7500	850	756	83,977					2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51		国	債	証	券	2.0000	3,460	2,590	287,617					2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53		国	債	証	券	1.7500	2,180	1,515	168,246					2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64		国	債	証	券	2.7500	390	339	37,706					2064/12/01
CANADA 2.75 12/01/55		国	債	証	券	2.7500	300	263	29,268					2055/12/01
CANADA 3.25 12/01/33		国	債	証	券	3.2500	2,100	2,056	228,316					2033/12/01
CANADA 0.5 12/01/30		国	債	証	券	0.5000	2,600	2,132	236,789					2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31		国	債	証	券	1.5000	2,420	2,089	231,956					2031/12/01
CANADA 2.5 12/01/32		国	債	証	券	2.5000	1,520	1,403	155,853					2032/12/01
CANADA 2.25 12/01/29		国	債	証	券	2.2500	700	655	72,741					2029/12/01
小計		—		—		50,260	46,076	5,115,401	—					
(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	1,090	849	83,589					2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25		国	債	証	券	3.2500	1,100	1,090	107,360					2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27		国	債	証	券	4.7500	1,540	1,585	156,040					2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26		国	債	証	券	4.2500	1,600	1,615	158,958					2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29		国	債	証	券	3.2500	1,400	1,362	134,035					2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33		国	債	証	券	4.5000	1,660	1,702	167,580					2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37		国	債	証	券	3.7500	830	783	77,150					2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28		国	債	証	券	2.2500	1,780	1,674	164,777					2028/05/21

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	
(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 2.5 05/21/30		国	債証券	2.5000	1,660	1,529	150,519	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41		国	債証券	2.7500	960	762	75,080	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32		国	債証券	1.2500	2,130	1,706	167,951	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34		国	債証券	3.7500	1,800	1,734	170,694	2034/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39		国	債証券	3.2500	820	716	70,462	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31		国	債証券	1.5000	2,010	1,689	166,222	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35		国	債証券	2.7500	650	563	55,483	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51		国	債証券	1.7500	2,520	1,420	139,792	2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26		国	債証券	0.5000	2,615	2,408	237,000	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28		国	債証券	2.7500	450	429	42,287	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27		国	債証券	2.7500	1,430	1,380	135,820	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29		国	債証券	2.7500	1,400	1,319	129,819	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33		国	債証券	3.0000	1,670	1,513	148,951	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32		国	債証券	1.7500	1,850	1,527	150,297	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31		国	債証券	1.0000	2,470	1,969	193,799	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25		国	債証券	0.2500	1,460	1,372	135,065	2025/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30		国	債証券	1.0000	1,670	1,374	135,234	2030/12/21
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34		国	債証券	3.5000	1,500	1,407	138,513	2034/12/21
小	計	—	—	—	40,065	35,489	3,492,489	—
(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 3.5 03/01/27		国	債証券	3.5000	800	810	90,501	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46		国	債証券	2.7500	460	441	49,339	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50		国	債証券	1.8750	840	672	75,082	2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42		国	債証券	2.7500	660	636	71,104	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28		国	債証券	2.6250	340	334	37,399	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25		国	債証券	2.3750	780	769	85,999	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26		国	債証券	2.1250	590	576	64,404	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29		国	債証券	2.8750	640	635	70,970	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39		国	債証券	2.3750	190	174	19,487	2039/07/01
SINGAPORE 1.625 07/01/31		国	債証券	1.6250	840	760	84,946	2031/07/01
SINGAPORE 3.0 08/01/72		国	債証券	3.0000	125	127	14,224	2072/08/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36		国	債証券	2.2500	890	816	91,260	2036/08/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30		国	債証券	2.8750	620	613	68,510	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33		国	債証券	3.3750	580	594	66,424	2033/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/27		国	債証券	2.8750	200	198	22,223	2027/09/01
SINGAPORE 1.875 10/01/51		国	債証券	1.8750	510	409	45,725	2051/10/01
SINGAPORE 1.25 11/01/26		国	債証券	1.2500	510	485	54,281	2026/11/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25		国	債証券	0.5000	280	267	29,842	2025/11/01
小	計	—	—	—	9,855	9,323	1,041,728	—
(ニュージーランド)				%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27		国	債証券	4.5000	800	793	73,529	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33		国	債証券	3.5000	450	406	37,662	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37		国	債証券	2.7500	810	635	58,902	2037/04/15
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25		国	債証券	2.7500	670	650	60,235	2025/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29		国	債証券	3.0000	750	693	64,206	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51		国	債証券	2.7500	540	355	32,892	2051/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41		国	債証券	1.7500	400	247	22,932	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31		国	債証券	1.5000	880	706	65,439	2031/05/15
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34		国	債証券	4.2500	130	123	11,456	2034/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32		国	債証券	2.0000	910	739	68,519	2032/05/15
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28		国	債証券	0.2500	650	540	50,074	2028/05/15

銘	柄	当		期			末			
		種	類	利	率	額	面	金	額	償還年月日
(ニュージーランド)					%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル		千円	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26		国	債	証	券	0.5000	580	526	48,766	2026/05/15
小計		—			—	7,570	6,419	594,617	—	
(イギリス)					%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44		国	債	証	券	3.2500	1,640	1,356	257,233	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45		国	債	証	券	3.5000	1,550	1,324	251,087	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60		国	債	証	券	4.0000	900	816	154,822	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49		国	債	証	券	1.7500	1,130	658	124,799	2049/01/22
UK TREASURY 3.75 01/29/38		国	債	証	券	3.7500	1,650	1,543	292,668	2038/01/29
UK TREASURY 0.875 01/31/46		国	債	証	券	0.8750	1,350	664	125,901	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39		国	債	証	券	1.1250	2,110	1,354	256,764	2039/01/31
UK TREASURY 4.625 01/31/34		国	債	証	券	4.6250	400	416	78,930	2034/01/31
UK TREASURY 1.0 01/31/32		国	債	証	券	1.0000	2,470	1,970	373,512	2032/01/31
UK TREASURY 3.25 01/31/33		国	債	証	券	3.2500	2,500	2,351	445,707	2033/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29		国	債	証	券	0.5000	1,880	1,590	301,513	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28		国	債	証	券	0.1250	1,340	1,152	218,484	2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25		国	債	証	券	0.2500	1,700	1,630	309,123	2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26		国	債	証	券	0.1250	1,750	1,617	306,579	2026/01/30
UK TREASURY 4.125 01/29/27		国	債	証	券	4.1250	2,340	2,334	442,643	2027/01/29
UK TREASURY 5.0 03/07/25		国	債	証	券	5.0000	1,485	1,488	282,244	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36		国	債	証	券	4.2500	1,300	1,302	246,995	2036/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32		国	債	証	券	4.2500	1,770	1,804	342,006	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25		国	債	証	券	0.6250	1,060	1,008	191,181	2025/06/07
UK TREASURY 4.5 06/07/28		国	債	証	券	4.5000	1,750	1,779	337,300	2028/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47		国	債	証	券	1.5000	1,200	671	127,395	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51		国	債	証	券	1.2500	1,730	839	159,095	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52		国	債	証	券	3.7500	970	841	159,613	2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53		国	債	証	券	1.5000	1,210	612	116,163	2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57		国	債	証	券	1.7500	1,260	664	125,977	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65		国	債	証	券	2.5000	1,250	790	149,810	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68		国	債	証	券	3.5000	1,480	1,209	229,224	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26		国	債	証	券	1.5000	1,900	1,785	338,431	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27		国	債	証	券	1.2500	1,100	1,002	190,046	2027/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33		国	債	証	券	0.8750	2,100	1,577	299,050	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31		国	債	証	券	0.2500	2,240	1,707	323,797	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35		国	債	証	券	0.6250	1,650	1,119	212,208	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39		国	債	証	券	4.2500	1,060	1,037	196,777	2039/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25		国	債	証	券	2.0000	1,110	1,069	202,679	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34		国	債	証	券	4.5000	1,200	1,235	234,298	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37		国	債	証	券	1.7500	1,890	1,394	264,361	2037/09/07
UK TREASURY 3.75 10/22/53		国	債	証	券	3.7500	1,800	1,553	294,531	2053/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/54		国	債	証	券	1.6250	1,270	659	124,953	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61		国	債	証	券	0.5000	1,880	553	105,010	2061/10/22
UK TREASURY 4.0 10/22/63		国	債	証	券	4.0000	820	741	140,616	2063/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71		国	債	証	券	1.6250	830	380	72,117	2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73		国	債	証	券	1.1250	740	267	50,729	2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41		国	債	証	券	1.2500	1,750	1,062	201,452	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50		国	債	証	券	0.6250	1,640	653	123,948	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28		国	債	証	券	1.6250	1,030	929	176,235	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29		国	債	証	券	0.8750	1,430	1,211	229,594	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30		国	債	証	券	0.3750	1,390	1,103	209,195	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26		国	債	証	券	0.3750	2,430	2,199	417,048	2026/10/22

銘 柄	当 期			末		
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	国 債 証 券	3.5000	1,500	1,475	279,692	2025/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国 債 証 券	6.0000	980	1,066	202,208	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国 債 証 券	4.7500	1,380	1,433	271,745	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国 債 証 券	4.5000	1,745	1,738	329,574	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国 債 証 券	4.2500	1,280	1,217	230,757	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国 債 証 券	4.2500	1,112	1,051	199,340	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国 債 証 券	4.2500	1,310	1,318	249,993	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国 債 証 券	4.2500	1,770	1,722	326,463	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国 債 証 券	4.7500	1,495	1,566	297,060	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国 債 証 券	4.2500	1,317	1,247	236,498	2049/12/07
小 計	—	—	86,324	70,878	13,437,202	—
(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	1,410	1,557	63,474	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国 債 証 券	0.5000	1,430	1,340	54,621	2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国 債 証 券	3.7500	1,810	1,561	63,652	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国 債 証 券	2.0000	1,660	1,573	64,133	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国 債 証 券	1.0000	2,860	2,401	97,869	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	国 債 証 券	1.3000	2,300	1,845	75,210	2032/04/30
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国 債 証 券	0.5000	1,890	1,819	74,162	2025/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国 債 証 券	1.5000	2,420	1,697	69,175	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国 債 証 券	1.7500	2,000	1,941	79,122	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国 債 証 券	2.2500	2,360	2,199	89,634	2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国 債 証 券	6.2500	1,220	1,294	52,768	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	国 債 証 券	2.8000	960	660	26,904	2052/11/29
小 計	—	—	22,320	19,889	810,730	—
(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	4,560	2,443	53,218	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国 債 証 券	4.5000	7,650	9,509	207,116	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国 債 証 券	1.7500	3,740	3,675	80,049	2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国 債 証 券	0.5000	4,850	4,516	98,367	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国 債 証 券	0.5000	5,140	4,627	100,786	2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国 債 証 券	0.0000	5,080	4,236	92,261	2031/11/15
DENMARK 2.25 11/15/33	国 債 証 券	2.2500	1,700	1,667	36,328	2033/11/15
小 計	—	—	32,720	30,676	668,129	—
(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	6,710	6,386	91,511	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国 債 証 券	1.7500	5,100	4,792	68,683	2027/02/17
NORWAY 1.75 03/13/25	国 債 証 券	1.7500	1,130	1,099	15,759	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国 債 証 券	2.0000	2,070	1,924	27,576	2028/04/26
NORWAY 2.125 05/18/32	国 債 証 券	2.1250	2,030	1,788	25,630	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国 債 証 券	1.3750	4,610	3,978	57,006	2030/08/19
NORWAY 3.0 08/15/33	国 債 証 券	3.0000	2,900	2,715	38,916	2033/08/15
NORWAY 1.75 09/06/29	国 債 証 券	1.7500	2,920	2,627	37,652	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国 債 証 券	1.2500	2,950	2,460	35,254	2031/09/17
NORWAY 3.5 10/06/42	国 債 証 券	3.5000	2,200	2,166	31,049	2042/10/06
小 計	—	—	32,620	29,940	429,040	—
(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	3,990	4,443	64,482	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国 債 証 券	0.7500	3,390	3,159	45,848	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国 債 証 券	2.5000	5,920	5,870	85,174	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国 債 証 券	0.1250	4,920	4,191	60,812	2031/05/12

銘	柄	当			期		末							
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	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 2.25 06/01/32		国	債	証	券	2.2500	4,050	4,004	58,106					2032/06/01
SWEDEN 1.0 11/12/26		国	債	証	券	1.0000	8,210	7,852	113,945					2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29		国	債	証	券	0.7500	3,960	3,622	52,565					2029/11/12
SWEDEN 1.75 11/11/33		国	債	証	券	1.7500	2,700	2,548	36,979					2033/11/11
小	計	—			—		37,140		35,693		517,914			—
(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	36,282	33,436	294,374					2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/04/27		国	債	証	券	5.5000	25,080	22,431	197,487					2027/03/04
MEXICAN BONDS 03/06/25		国	債	証	券	5.0000	3,680	3,495	30,777					2025/03/06
MEXICAN BONDS 03/01/29		国	債	証	券	8.5000	9,500	9,173	80,763					2029/03/01
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29		国	債	証	券	8.5000	24,159	23,435	206,327					2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31		国	債	証	券	7.7500	30,148	27,780	244,579					2031/05/29
MEXICAN BONDS 05/26/33		国	債	証	券	7.5000	19,290	17,202	151,446					2033/05/26
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27		国	債	証	券	7.5000	28,146	26,588	234,081					2027/06/03
MEXICAN BONDS 07/31/53		国	債	証	券	8.0000	13,290	11,397	100,340					2053/07/31
MEXICAN BONDS 09/03/26		国	債	証	券	7.0000	8,000	7,502	66,049					2026/09/03
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42		国	債	証	券	7.7500	24,707	21,151	186,219					2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47		国	債	証	券	8.0000	19,561	17,001	149,680					2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38		国	債	証	券	8.5000	15,642	14,631	128,813					2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36		国	債	証	券	10.0000	5,485	5,803	51,092					2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34		国	債	証	券	7.7500	10,035	9,020	79,413					2034/11/23
小	計	—			—		273,005		250,053		2,201,447			—
(中国)					%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円						
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32		国	債	証	券	2.7500	15,500	15,832	329,979					2032/02/17
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33		国	債	証	券	2.8800	11,200	11,589	241,546					2033/02/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25		国	債	証	券	2.2600	40,500	40,634	846,893					2025/02/24
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50		国	債	証	券	3.3900	19,100	21,625	450,709					2050/03/16
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29		国	債	証	券	2.8000	11,000	11,253	234,531					2029/03/24
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26		国	債	証	券	3.0300	54,000	55,050	1,147,353					2026/03/11
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30		国	債	証	券	2.8000	10,000	10,231	213,231					2030/03/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52		国	債	証	券	3.3200	15,820	17,880	372,661					2052/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51		国	債	証	券	3.7200	7,600	9,140	190,494					2051/04/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53		国	債	証	券	3.1900	8,500	9,524	198,515					2053/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27		国	債	証	券	2.4800	25,100	25,320	527,716					2027/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31		国	債	証	券	3.0200	18,500	19,263	401,475					2031/05/27
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32		国	債	証	券	2.7600	9,000	9,195	191,659					2032/05/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33		国	債	証	券	2.6700	14,500	14,741	307,229					2033/05/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28		国	債	証	券	3.0100	54,000	55,641	1,159,653					2028/05/13
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29		国	債	証	券	3.2900	4,000	4,205	87,647					2029/05/23
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30		国	債	証	券	2.6800	64,600	65,640	1,368,063					2030/05/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26		国	債	証	券	2.3000	39,500	39,609	825,527					2026/05/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25		国	債	証	券	2.2400	8,490	8,500	177,163					2025/05/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27		国	債	証	券	2.8500	23,500	23,977	499,730					2027/06/04
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29		国	債	証	券	2.7500	22,000	22,447	467,837					2029/06/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26		国	債	証	券	3.2500	18,450	18,952	395,004					2026/06/06
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30		国	債	証	券	2.6200	10,000	10,119	210,916					2030/06/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49		国	債	証	券	3.8600	5,800	7,059	147,125					2049/07/22
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28		国	債	証	券	2.4000	25,000	25,102	523,181					2028/07/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27		国	債	証	券	2.5000	20,410	20,567	428,669					2027/07/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32		国	債	証	券	2.6900	21,000	21,379	445,593					2032/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25		国	債	証	券	2.1800	20,000	20,016	417,187					2025/08/25

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									
(中国)					%	千	オ	フ	シ	ョ	・	人	民	元	千	オ	フ	シ	ョ	・	人	民	元	千	円					
CHINA GOVERNMENT BOND	2.69 08/12/26	国	債	証	券	2.6900	60,600	61,382	1,279,310	2026/08/12																				
CHINA GOVERNMENT BOND	3.59 08/03/27	国	債	証	券	3.5900	5,000	5,262	109,681	2027/08/03																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.18 08/15/26	国	債	証	券	2.1800	42,000	41,999	875,345	2026/08/15																				
CHINA GOVERNMENT BOND	3.81 09/14/50	国	債	証	券	3.8100	17,500	21,268	443,269	2050/09/14																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6 09/01/32	国	債	証	券	2.6000	18,300	18,441	384,348	2032/09/01																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6 09/15/30	国	債	証	券	2.6000	3,000	3,034	63,243	2030/09/15																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.62 09/25/29	国	債	証	券	2.6200	18,000	18,257	380,521	2029/09/25																				
CHINA GOVERNMENT BOND	3.12 10/25/52	国	債	証	券	3.1200	9,500	10,348	215,677	2052/10/25																				
CHINA GOVERNMENT BOND	3.53 10/18/51	国	債	証	券	3.5300	12,450	14,536	302,960	2051/10/18																				
CHINA GOVERNMENT BOND	4.08 10/22/48	国	債	証	券	4.0800	10,300	12,842	267,651	2048/10/22																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.91 10/14/28	国	債	証	券	2.9100	29,100	29,934	623,887	2028/10/14																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.44 10/15/27	国	債	証	券	2.4400	21,000	21,134	440,477	2027/10/15																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8 11/15/32	国	債	証	券	2.8000	31,300	32,050	667,976	2032/11/15																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.89 11/18/31	国	債	証	券	2.8900	15,100	15,568	324,466	2031/11/18																				
CHINA GOVERNMENT BOND	3.27 11/19/30	国	債	証	券	3.2700	3,000	3,166	65,990	2030/11/19																				
CHINA GOVERNMENT BOND	3.13 11/21/29	国	債	証	券	3.1300	8,000	8,341	173,843	2029/11/21																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.28 11/25/25	国	債	証	券	2.2800	31,800	31,878	664,392	2025/11/25																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.39 11/15/26	国	債	証	券	2.3900	22,000	22,131	461,263	2026/11/15																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.54 12/25/30	国	債	証	券	2.5400	3,000	3,021	62,981	2030/12/25																				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.79 12/15/29	国	債	証	券	2.7900	24,000	24,550	511,670	2029/12/15																				
CHINA GOVERNMENT BOND	3.28 12/03/27	国	債	証	券	3.2800	18,500	19,287	401,976	2027/12/03																				
小	計	—	—	—	—	1,000,520	1,032,940	21,528,239	—	—																				
(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	1,000	1,011	31,652	2027/03/15																				
MALAYSIA	4.457 03/31/53	国	債	証	券	4.4570	2,000	2,077	64,985	2053/03/31																				
MALAYSIA	4.736 03/15/46	国	債	証	券	4.7360	300	324	10,155	2046/03/15																				
MALAYSIA	4.392 04/15/26	国	債	証	券	4.3920	1,050	1,070	33,485	2026/04/15																				
MALAYSIA	4.498 04/15/30	国	債	証	券	4.4980	1,200	1,250	39,132	2030/04/15																				
MALAYSIA	3.844 04/15/33	国	債	証	券	3.8440	1,660	1,655	51,799	2033/04/15																				
MALAYSIA	4.762 04/07/37	国	債	証	券	4.7620	1,700	1,835	57,423	2037/04/07																				
MALAYSIA	2.632 04/15/31	国	債	証	券	2.6320	1,100	1,020	31,914	2031/04/15																				
MALAYSIA	4.504 04/30/29	国	債	証	券	4.5040	2,950	3,068	96,012	2029/04/30																				
MALAYSIA	3.502 05/31/27	国	債	証	券	3.5020	650	650	20,346	2027/05/31																				
MALAYSIA	3.757 05/22/40	国	債	証	券	3.7570	1,500	1,447	45,274	2040/05/22																				
MALAYSIA	4.254 05/31/35	国	債	証	券	4.2540	1,400	1,437	44,977	2035/05/31																				
MALAYSIA	3.733 06/15/28	国	債	証	券	3.7330	2,000	2,008	62,822	2028/06/15																				
MALAYSIA	4.232 06/30/31	国	債	証	券	4.2320	670	687	21,501	2031/06/30																				
MALAYSIA	4.065 06/15/50	国	債	証	券	4.0650	1,700	1,664	52,076	2050/06/15																				
MALAYSIA	4.921 07/06/48	国	債	証	券	4.9210	1,990	2,203	68,947	2048/07/06																				
MALAYSIA	3.906 07/15/26	国	債	証	券	3.9060	1,920	1,942	60,766	2026/07/15																				
MALAYSIA	3.828 07/05/34	国	債	証	券	3.8280	1,820	1,811	56,668	2034/07/05																				
MALAYSIA	3.582 07/15/32	国	債	証	券	3.5820	1,400	1,372	42,924	2032/07/15																				
MALAYSIA	3.885 08/15/29	国	債	証	券	3.8850	700	707	22,148	2029/08/15																				
MALAYSIA	3.955 09/15/25	国	債	証	券	3.9550	1,950	1,964	61,467	2025/09/15																				
MALAYSIA	4.935 09/30/43	国	債	証	券	4.9350	1,600	1,767	55,286	2043/09/30																				
MALAYSIA	4.696 10/15/42	国	債	証	券	4.6960	960	1,035	32,410	2042/10/15																				
MALAYSIA	3.9 11/30/26	国	債	証	券	3.9000	1,660	1,679	52,550	2026/11/30																				
MALAYSIA	3.899 11/16/27	国	債	証	券	3.8990	1,730	1,752	54,811	2027/11/16																				
MALAYSIA	4.642 11/07/33	国	債	証	券	4.6420	1,450	1,540	48,191	2033/11/07																				
小	計	—	—	—	—	38,060	38,987	1,219,734	—	—																				

銘	柄	当			期			末				
		種	類	利	率	額	面	金	額	償還年月日		
(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	3,190		3,265		122,805	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28		国	債	証	券	2.7500	3,460		3,162		118,954	2028/04/25
POLAND 1.75 04/25/32		国	債	証	券	1.7500	5,440		4,178		157,143	2032/04/25
POLAND 0.75 04/25/25		国	債	証	券	0.7500	4,170		3,973		149,430	2025/04/25
POLAND 3.75 05/25/27		国	債	証	券	3.7500	3,650		3,511		132,070	2027/05/25
POLAND 2.5 07/25/26		国	債	証	券	2.5000	3,290		3,104		116,759	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25		国	債	証	券	3.2500	1,590		1,551		58,339	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27		国	債	証	券	2.5000	2,360		2,175		81,802	2027/07/25
POLAND 7.5 07/25/28		国	債	証	券	7.5000	3,400		3,709		139,526	2028/07/25
POLAND 2.75 10/25/29		国	債	証	券	2.7500	2,000		1,767		66,476	2029/10/25
POLAND 1.25 10/25/30		国	債	証	券	1.2500	4,720		3,684		138,558	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26		国	債	証	券	0.2500	1,880		1,661		62,470	2026/10/25
小	計	—	—	—	—	39,150		35,744		1,344,336	—	
(ユーロ…アイルランド)					%	千ユーロ	千ユーロ		千円			
IRISH 2.0 02/18/45		国	債	証	券	2.0000	840		708		115,032	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31		国	債	証	券	1.3500	660		608		98,854	2031/03/18
IRISH 5.4 03/13/25		国	債	証	券	5.4000	590		602		97,848	2025/03/13
IRISH 0.55 04/22/41		国	債	証	券	0.5500	250		169		27,533	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50		国	債	証	券	1.5000	650		472		76,713	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33		国	債	証	券	1.3000	290		257		41,861	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30		国	債	証	券	2.4000	960		951		154,412	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28		国	債	証	券	0.9000	710		664		107,847	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29		国	債	証	券	1.1000	730		678		110,182	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26		国	債	証	券	1.0000	1,120		1,079		175,166	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37		国	債	証	券	1.7000	780		678		110,181	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35		国	債	証	券	0.4000	370		286		46,572	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27		国	債	証	券	0.2000	420		389		63,203	2027/05/15
IRISH 3.0 10/18/43		国	債	証	券	3.0000	210		211		34,264	2043/10/18
IRISH 0.0 10/18/31		国	債	証	券	0.0000	670		550		89,393	2031/10/18
IRISH 0.35 10/18/32		国	債	証	券	0.3500	600		495		80,386	2032/10/18
IRISH 0.2 10/18/30		国	債	証	券	0.2000	350		300		48,749	2030/10/18
小	計	—	—	—	—	10,200		9,105		1,478,204	—	
(ユーロ…オランダ)					%	千ユーロ	千ユーロ		千円			
NETHERLANDS 3.75 01/15/42		国	債	証	券	3.7500	1,320		1,495		242,756	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47		国	債	証	券	2.7500	1,710		1,708		277,407	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52		国	債	証	券	0.0000	1,430		688		111,827	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28		国	債	証	券	5.5000	1,090		1,202		195,264	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37		国	債	証	券	4.0000	1,320		1,489		241,846	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33		国	債	証	券	2.5000	1,310		1,301		211,215	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38		国	債	証	券	0.0000	990		675		109,626	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40		国	債	証	券	0.5000	1,310		929		150,963	2040/01/15
NETHERLANDS 2.0 01/15/54		国	債	証	券	2.0000	660		563		91,466	2054/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29		国	債	証	券	0.0000	1,030		911		147,947	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27		国	債	証	券	0.0000	1,280		1,187		192,795	2027/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/26		国	債	証	券	0.0000	2,180		2,065		335,374	2026/01/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26		国	債	証	券	0.5000	1,820		1,727		280,449	2026/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28		国	債	証	券	0.7500	1,480		1,371		222,591	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27		国	債	証	券	0.7500	1,460		1,374		223,123	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29		国	債	証	券	0.2500	1,360		1,206		195,842	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30		国	債	証	券	0.0000	700		596		96,847	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31		国	債	証	券	0.0000	1,900		1,577		256,126	2031/07/15

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…オランダ)					%			千ユーロ		千ユーロ	千円		
NETHERLANDS 2.5 07/15/33		国	債	証	券	2.5000	350			346	56,179	2033/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32		国	債	証	券	0.5000	1,000			844	137,122	2032/07/15	
小 計		—	—	—	—	25,700				23,264	3,776,775	—	
(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	1,600			1,776	288,389	2028/03/28	
BELGIUM 4.25 03/28/41		国	債	証	券	4.2500	1,280			1,450	235,491	2041/03/28	
BELGIUM 4.5 03/28/26		国	債	証	券	4.5000	1,070			1,105	179,418	2026/03/28	
BELGIUM 4.0 03/28/32		国	債	証	券	4.0000	930			1,013	164,453	2032/03/28	
BELGIUM 5.0 03/28/35		国	債	証	券	5.0000	1,570			1,867	303,248	2035/03/28	
BELGIUM 1.25 04/22/33		国	債	証	券	1.2500	1,110			973	158,033	2033/04/22	
BELGIUM 2.75 04/22/39		国	債	証	券	2.7500	320			304	49,401	2039/04/22	
BELGIUM 3.75 06/22/45		国	債	証	券	3.7500	640			683	110,954	2045/06/22	
BELGIUM 1.6 06/22/47		国	債	証	券	1.6000	920			664	107,920	2047/06/22	
BELGIUM 1.7 06/22/50		国	債	証	券	1.7000	960			686	111,405	2050/06/22	
BELGIUM 1.4 06/22/53		国	債	証	券	1.4000	1,390			889	144,352	2053/06/22	
BELGIUM 3.3 06/22/54		国	債	証	券	3.3000	270			264	43,005	2054/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/57		国	債	証	券	2.2500	390			304	49,363	2057/06/22	
BELGIUM 2.15 06/22/66		国	債	証	券	2.1500	450			336	54,614	2066/06/22	
BELGIUM 0.65 06/22/71		国	債	証	券	0.6500	870			366	59,536	2071/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26		国	債	証	券	1.0000	1,460			1,401	227,450	2026/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31		国	債	証	券	1.0000	1,570			1,393	226,228	2031/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28		国	債	証	券	0.8000	940			867	140,834	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40		国	債	証	券	0.4000	930			600	97,519	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29		国	債	証	券	0.9000	1,350			1,235	200,622	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34		国	債	証	券	3.0000	580			584	94,898	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38		国	債	証	券	1.9000	610			523	84,915	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25		国	債	証	券	0.8000	1,380			1,337	217,178	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27		国	債	証	券	0.8000	1,210			1,138	184,787	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37		国	債	証	券	1.4500	780			641	104,095	2037/06/22	
BELGIUM 3.45 06/22/43		国	債	証	券	3.4500	240			245	39,829	2043/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30		国	債	証	券	0.1000	1,200			1,022	166,015	2030/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/33		国	債	証	券	3.0000	1,200			1,213	197,039	2033/06/22	
BELGIUM 0.35 06/22/32		国	債	証	券	0.3500	1,050			861	139,842	2032/06/22	
BELGIUM 0.0 10/22/31		国	債	証	券	0.0000	1,040			845	137,314	2031/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/27		国	債	証	券	0.0000	1,080			980	159,248	2027/10/22	
小 計		—	—	—	—	30,390				27,580	4,477,411	—	
(ユーロ…フランス)					%			千ユーロ		千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.0 02/25/27		国	債	証	券	0.0000	3,700			3,413	554,081	2027/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26		国	債	証	券	0.0000	3,530			3,335	541,536	2026/02/25	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28		国	債	証	券	0.7500	3,780			3,509	569,691	2028/02/25	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29		国	債	証	券	2.7500	3,100			3,112	505,345	2029/02/25	
FRANCE OAT 03/25/25		国	債	証	券	0.0000	1,570			1,515	245,982	2025/03/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26		国	債	証	券	3.5000	3,850			3,903	633,708	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41		国	債	証	券	4.5000	2,690			3,164	513,653	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55		国	債	証	券	4.0000	1,530			1,728	280,656	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60		国	債	証	券	4.0000	1,460			1,673	271,725	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29		国	債	証	券	5.5000	3,100			3,518	571,247	2029/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35		国	債	証	券	4.7500	2,330			2,729	443,077	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45		国	債	証	券	3.2500	2,540			2,541	412,649	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48		国	債	証	券	2.0000	1,950			1,539	249,906	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50		国	債	証	券	1.5000	3,720			2,568	416,982	2050/05/25	

銘	柄	当			期		末					
		種	類	利	率	額	面	金	額	償還年月日		
											外	貨
(ユーロ…フランス)					%		千ユーロ		千ユーロ		千円	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52		国	債	証	券	0.7500	3,470		1,878		305,020	2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53		国	債	証	券	0.7500	3,660		1,938		314,732	2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66		国	債	証	券	1.7500	940		636		103,318	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72		国	債	証	券	0.5000	790		306		49,798	2072/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30		国	債	証	券	2.5000	4,650		4,611		748,628	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28		国	債	証	券	0.7500	5,090		4,707		764,175	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31		国	債	証	券	1.5000	5,780		5,338		866,601	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25		国	債	証	券	0.5000	3,430		3,317		538,591	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29		国	債	証	券	0.5000	3,590		3,218		522,455	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34		国	債	証	券	1.2500	3,560		3,051		495,395	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26		国	債	証	券	0.5000	4,960		4,712		765,097	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27		国	債	証	券	1.0000	3,560		3,374		547,800	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40		国	債	証	券	0.5000	1,950		1,298		210,748	2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36		国	債	証	券	1.2500	4,080		3,353		544,449	2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38		国	債	証	券	1.2500	900		708		115,058	2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43		国	債	証	券	2.5000	1,200		1,073		174,267	2043/05/25
FRANCE OAT 3.0 05/25/33		国	債	証	券	3.0000	3,000		3,046		494,567	2033/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32		国	債	証	券	0.0000	2,790		2,232		362,342	2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39		国	債	証	券	1.7500	2,450		2,055		333,667	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44		国	債	証	券	0.5000	1,490		893		145,019	2044/06/25
FRANCE OAT 2.5 09/24/26		国	債	証	券	2.5000	4,120		4,090		664,120	2026/09/24
FRANCE OAT 6.0 10/25/25		国	債	証	券	6.0000	2,170		2,274		369,268	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27		国	債	証	券	2.7500	3,240		3,247		527,129	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38		国	債	証	券	4.0000	2,040		2,258		366,661	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32		国	債	証	券	5.7500	2,610		3,196		518,890	2032/10/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25		国	債	証	券	1.0000	2,740		2,649		430,136	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26		国	債	証	券	0.2500	4,020		3,757		609,921	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28		国	債	証	券	0.7500	4,600		4,216		684,425	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31		国	債	証	券	0.0000	3,670		2,983		484,326	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30		国	債	証	券	0.0000	4,280		3,582		581,580	2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32		国	債	証	券	2.0000	3,850		3,622		588,020	2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29		国	債	証	券	0.0000	3,590		3,090		501,787	2029/11/25
小	計	—			—		141,120		128,977		20,938,250	—
(ユーロ…ドイツ)					%		千ユーロ		千ユーロ		千円	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28		国	債	証	券	5.6250	1,310		1,460		237,126	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30		国	債	証	券	6.2500	840		1,017		165,110	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31		国	債	証	券	5.5000	2,620		3,139		509,635	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37		国	債	証	券	4.0000	2,030		2,365		383,970	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25		国	債	証	券	0.5000	1,650		1,606		260,751	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26		国	債	証	券	0.5000	3,860		3,693		599,524	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29		国	債	証	券	0.2500	1,430		1,292		209,847	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28		国	債	証	券	0.5000	2,120		1,970		319,897	2028/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27		国	債	証	券	0.2500	2,420		2,264		367,601	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31		国	債	証	券	0.0000	2,340		1,999		324,656	2031/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33		国	債	証	券	2.3000	3,050		3,045		494,359	2033/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32		国	債	証	券	0.0000	2,500		2,086		338,727	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30		国	債	証	券	0.0000	1,720		1,502		243,849	2030/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33		国	債	証	券	2.3000	700		698		113,433	2033/02/15
BUNDESUBL 0.0 04/11/25		国	債	証	券	0.0000	1,590		1,534		249,117	2025/04/11
BUNDESUBL 2.2 04/13/28		国	債	証	券	2.2000	2,100		2,083		338,203	2028/04/13
BUNDESUBL 0.0 04/10/26		国	債	証	券	0.0000	3,510		3,315		538,291	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		
BUNDESUBL 0.0 04/16/27		国	債	証	券	0.0000	2,060		1,906		309,455		2027/04/16
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35		国	債	証	券	0.0000	1,760		1,344		218,291		2035/05/15
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38		国	債	証	券	1.0000	1,660		1,358		220,475		2038/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36		国	債	証	券	0.0000	1,880		1,394		226,448		2036/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27		国	債	証	券	6.5000	650		731		118,831		2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28		国	債	証	券	4.7500	1,180		1,292		209,857		2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39		国	債	証	券	4.2500	1,730		2,097		340,472		2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42		国	債	証	券	3.2500	1,330		1,456		236,518		2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44		国	債	証	券	2.5000	2,320		2,289		371,653		2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40		国	債	証	券	4.7500	1,610		2,075		336,902		2040/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34		国	債	証	券	4.7500	2,020		2,450		397,834		2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46		国	債	証	券	2.5000	2,240		2,215		359,662		2046/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52		国	債	証	券	0.0000	2,540		1,258		204,270		2052/08/15
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53		国	債	証	券	1.8000	1,850		1,571		255,105		2053/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48		国	債	証	券	1.2500	2,820		2,164		351,439		2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25		国	債	証	券	1.0000	2,420		2,350		381,540		2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27		国	債	証	券	0.5000	2,610		2,443		396,671		2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26		国	債	証	券	0.0000	3,590		3,367		546,672		2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28		国	債	証	券	0.2500	2,570		2,344		380,561		2028/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29		国	債	証	券	0.0000	2,290		2,021		328,216		2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50		国	債	証	券	0.0000	3,140		1,632		264,969		2050/08/15
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32		国	債	証	券	1.7000	2,330		2,222		360,879		2032/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31		国	債	証	券	0.0000	2,890		2,443		396,601		2031/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50		国	債	証	券	0.0000	1,010		527		85,639		2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30		国	債	証	券	0.0000	3,730		3,223		523,261		2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30		国	債	証	券	0.0000	890		768		124,796		2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31		国	債	証	券	0.0000	1,100		929		150,960		2031/08/15
BUNDESUBL 0.0 10/09/26		国	債	証	券	0.0000	2,760		2,580		418,939		2026/10/09
BUNDESUBL 0.0 10/10/25		国	債	証	券	0.0000	2,650		2,529		410,601		2025/10/10
BUNDESUBL 1.3 10/15/27		国	債	証	券	1.3000	2,280		2,191		355,829		2027/10/15
BUNDESUBL 1.3 10/15/27		国	債	証	券	1.3000	1,050		1,009		163,950		2027/10/15
BUNDESUBL 0.0 10/10/25		国	債	証	券	0.0000	1,350		1,290		209,524		2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27		国	債	証	券	0.0000	1,620		1,481		240,547		2027/11/15
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28		国	債	証	券	0.0000	2,560		2,295		372,664		2028/11/15
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30		国	債	証	券	2.4000	300		301		48,942		2030/11/15
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29		国	債	証	券	2.1000	2,000		1,975		320,653		2029/11/15
小	計	—			—		108,580		100,614		16,333,748		—
(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	1,960		2,238		363,423		2029/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37		国	債	証	券	4.2000	1,660		1,792		290,935		2037/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25		国	債	証	券	0.0000	1,330		1,288		209,149		2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/27		国	債	証	券	0.0000	1,910		1,755		284,907		2027/01/31
SPAIN 0.0 01/31/28		国	債	証	券	0.0000	1,880		1,678		272,436		2028/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26		国	債	証	券	0.0000	1,640		1,548		251,458		2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25		国	債	証	券	1.6000	1,630		1,598		259,500		2025/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27		国	債	証	券	1.5000	1,510		1,446		234,837		2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26		国	債	証	券	1.9500	1,730		1,693		274,938		2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28		国	債	証	券	1.4000	2,170		2,044		331,931		2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29		国	債	証	券	1.4500	1,500		1,396		226,756		2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32		国	債	証	券	0.7000	1,850		1,533		248,942		2032/04/30
SPAIN 3.15 04/30/33		国	債	証	券	3.1500	1,570		1,565		254,101		2033/04/30

銘	柄	当			期			末						
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	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	1,800	1,553	252,120				2030/04/30	
SPAIN 0.1 04/30/31		国	債	証	券	0.1000	1,880	1,527	247,974				2031/04/30	
SPAIN 3.5 05/31/29		国	債	証	券	3.5000	500	513	83,408				2029/05/31	
SPAIN 2.8 05/31/26		国	債	証	券	2.8000	1,800	1,792	290,984				2026/05/31	
SPAIN 0.0 05/31/25		国	債	証	券	0.0000	870	835	135,584				2025/05/31	
SPAIN 5.9 07/30/26		国	債	証	券	5.9000	2,330	2,488	403,962				2026/07/30	
SPAIN 4.9 07/30/40		国	債	証	券	4.9000	1,910	2,202	357,479				2040/07/30	
SPAIN 4.7 07/30/41		国	債	証	券	4.7000	1,880	2,135	346,662				2041/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/66		国	債	証	券	3.4500	1,120	1,012	164,419				2066/07/30	
SPAIN 4.65 07/30/25		国	債	証	券	4.6500	1,895	1,933	313,918				2025/07/30	
SPAIN 1.95 07/30/30		国	債	証	券	1.9500	1,770	1,665	270,353				2030/07/30	
SPAIN 5.75 07/30/32		国	債	証	券	5.7500	1,965	2,350	381,630				2032/07/30	
SPAIN 2.35 07/30/33		国	債	証	券	2.3500	1,870	1,740	282,629				2033/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/43		国	債	証	券	3.4500	740	710	115,353				2043/07/30	
SPAIN 1.4 07/30/28		国	債	証	券	1.4000	2,170	2,038	330,964				2028/07/30	
SPAIN 1.85 07/30/35		国	債	証	券	1.8500	1,940	1,667	270,762				2035/07/30	
SPAIN 0.85 07/30/37		国	債	証	券	0.8500	1,600	1,149	186,678				2037/07/30	
SPAIN 1.0 07/30/42		国	債	証	券	1.0000	540	348	56,648				2042/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/27		国	債	証	券	0.8000	1,550	1,443	234,289				2027/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/29		国	債	証	券	0.8000	1,700	1,513	245,744				2029/07/30	
SPAIN 5.15 10/31/28		国	債	証	券	5.1500	2,060	2,256	366,374				2028/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/44		国	債	証	券	5.1500	1,210	1,457	236,662				2044/10/31	
SPAIN 2.9 10/31/46		国	債	証	券	2.9000	1,300	1,134	184,116				2046/10/31	
SPAIN 2.7 10/31/48		国	債	証	券	2.7000	1,560	1,292	209,805				2048/10/31	
SPAIN 1.9 10/31/52		国	債	証	券	1.9000	1,270	846	137,401				2052/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/71		国	債	証	券	1.4500	660	321	52,136				2071/10/31	
SPAIN 1.0 10/31/50		国	債	証	券	1.0000	1,790	963	156,389				2050/10/31	
SPAIN 2.15 10/31/25		国	債	証	券	2.1500	1,810	1,784	289,724				2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27		国	債	証	券	1.4500	1,860	1,768	287,018				2027/10/31	
SPAIN 1.3 10/31/26		国	債	証	券	1.3000	2,630	2,521	409,413				2026/10/31	
SPAIN 0.6 10/31/29		国	債	証	券	0.6000	2,130	1,872	303,968				2029/10/31	
SPAIN 0.5 10/31/31		国	債	証	券	0.5000	2,140	1,769	287,305				2031/10/31	
SPAIN 2.55 10/31/32		国	債	証	券	2.5500	1,720	1,644	266,943				2032/10/31	
SPAIN 1.2 10/31/40		国	債	証	券	1.2000	1,810	1,261	204,801				2040/10/31	
SPAIN 1.25 10/31/30		国	債	証	券	1.2500	2,450	2,187	355,135				2030/10/31	
SPAIN 3.55 10/31/33		国	債	証	券	3.5500	1,820	1,867	303,199				2033/10/31	
小	計	—			—		82,390	77,154	12,525,285				—	
(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	1,710	1,603	260,306				2027/01/15	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26		国	債	証	券	3.5000	1,310	1,316	213,707				2026/01/15	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33		国	債	証	券	5.7500	2,660	3,071	498,627				2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37		国	債	証	券	4.0000	1,470	1,472	239,117				2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28		国	債	証	券	2.0000	2,540	2,430	394,583				2028/02/01	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26		国	債	証	券	0.5000	1,610	1,528	248,192				2026/02/01	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29		国	債	証	券	0.4500	1,800	1,566	254,297				2029/02/15	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47		国	債	証	券	2.7000	1,270	989	160,649				2047/03/01	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48		国	債	証	券	3.4500	1,690	1,491	242,136				2048/03/01	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67		国	債	証	券	2.8000	400	289	47,000				2067/03/01	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72		国	債	証	券	2.1500	360	216	35,094				2072/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26		国	債	証	券	4.5000	2,110	2,163	351,237				2026/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32		国	債	証	券	1.6500	2,290	1,983	322,022				2032/03/01	

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 3.1 03/01/40		国	債	証	券	3.1000	1,060			927		150,556	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35		国	債	証	券	3.3500	2,120			2,014		327,063	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30		国	債	証	券	3.5000	2,170			2,183		354,505	2030/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36		国	債	証	券	1.4500	1,320			1,005		163,245	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41		国	債	証	券	1.8000	1,150			818		132,867	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37		国	債	証	券	0.9500	1,480			1,026		166,718	2037/03/01
ITALY BTPS 3.25 03/01/38		国	債	証	券	3.2500	600			545		88,579	2038/03/01
ITALY BTPS 4.2 03/01/34		国	債	証	券	4.2000	400			412		66,994	2034/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28		国	債	証	券	0.2500	1,460			1,299		210,944	2028/03/15
ITALY BTPS 4.0 04/30/35		国	債	証	券	4.0000	1,160			1,171		190,235	2035/04/30
ITALY BTPS 1.5 04/30/45		国	債	証	券	1.5000	1,110			694		112,713	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30		国	債	証	券	1.3500	1,550			1,375		223,276	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31		国	債	証	券	0.9000	2,110			1,766		286,838	2031/04/01
ITALY BTPS 3.4 04/01/28		国	債	証	券	3.4000	1,150			1,158		188,072	2028/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/01/26		国	債	証	券	0.0000	2,020			1,890		306,906	2026/04/01
ITALY BTPS 1.1 04/01/27		国	債	証	券	1.1000	1,300			1,221		198,368	2027/04/01
ITALY BTPS 3.8 04/15/26		国	債	証	券	3.8000	1,500			1,519		246,661	2026/04/15
ITALY BTPS 6.0 05/01/31		国	債	証	券	6.0000	2,260			2,621		425,553	2031/05/01
ITALY BTPS 1.45 05/15/25		国	債	証	券	1.4500	1,430			1,397		226,943	2025/05/15
ITALY BTPS 4.4 05/01/33		国	債	証	券	4.4000	1,600			1,685		273,614	2033/05/01
ITALY BTPS 1.6 06/01/26		国	債	証	券	1.6000	2,850			2,753		447,077	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25		国	債	証	券	1.5000	1,560			1,524		247,437	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27		国	債	証	券	2.2000	1,590			1,544		250,738	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32		国	債	証	券	0.9500	1,580			1,282		208,224	2032/06/01
ITALY BTPS 2.8 06/15/29		国	債	証	券	2.8000	1,200			1,169		189,781	2029/06/15
ITALY BTPS 3.7 06/15/30		国	債	証	券	3.7000	1,400			1,418		230,276	2030/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26		国	債	証	券	2.1000	1,790			1,747		283,749	2026/07/15
ITALY BTPS 0.5 07/15/28		国	債	証	券	0.5000	1,100			979		159,002	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25		国	債	証	券	1.8500	1,240			1,215		197,396	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34		国	債	証	券	5.0000	2,360			2,591		420,706	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39		国	債	証	券	5.0000	1,890			2,063		335,050	2039/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27		国	債	証	券	2.0500	1,700			1,639		266,236	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29		国	債	証	券	3.0000	2,210			2,173		352,882	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31		国	債	証	券	0.6000	1,920			1,554		252,364	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30		国	債	証	券	0.9500	1,350			1,156		187,819	2030/08/01
ITALY BTPS 1.2 08/15/25		国	債	証	券	1.2000	1,360			1,318		214,039	2025/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26		国	債	証	券	0.0000	1,850			1,714		278,404	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38		国	債	証	券	2.9500	1,520			1,321		214,555	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44		国	債	証	券	4.7500	1,560			1,658		269,197	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46		国	債	証	券	3.2500	1,380			1,185		192,407	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28		国	債	証	券	4.7500	2,180			2,316		376,027	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40		国	債	証	券	5.0000	1,650			1,802		292,638	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50		国	債	証	券	2.4500	1,200			863		140,183	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51		国	債	証	券	1.7000	1,120			677		110,034	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33		国	債	証	券	2.4500	1,330			1,195		194,047	2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52		国	債	証	券	2.1500	960			632		102,624	2052/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49		国	債	証	券	3.8500	1,380			1,290		209,522	2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36		国	債	証	券	2.2500	1,360			1,128		183,161	2036/09/01
ITALY BTPS 4.45 09/01/43		国	債	証	券	4.4500	800			816		132,586	2043/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27		国	債	証	券	0.9500	1,680			1,556		252,712	2027/09/15
ITALY BTPS 3.85 09/15/26		国	債	証	券	3.8500	1,500			1,524		247,503	2026/09/15

銘	柄	当			期		末								
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日		
														外	貨
(ユーロ…イタリア)					%		千	ユーロ		千	ユーロ		千	円	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53		国	債	証	券	4.5000		670		684			111,073		2053/10/01
ITALY BTPS 4.0 10/30/31		国	債	証	券	4.0000		1,400		1,441			234,048		2031/10/30
ITALY BTPS 7.25 11/01/26		国	債	証	券	7.2500		1,250		1,381			224,293		2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27		国	債	証	券	6.5000		2,010		2,242			363,991		2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29		国	債	証	券	5.2500		2,640		2,902			471,221		2029/11/01
ITALY BTPS 2.5 11/15/25		国	債	証	券	2.5000		1,550		1,531			248,654		2025/11/15
ITALY BTPS 2.0 12/01/25		国	債	証	券	2.0000		1,660		1,625			263,935		2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26		国	債	証	券	1.2500		2,180		2,072			336,527		2026/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28		国	債	証	券	2.8000		1,940		1,902			308,884		2028/12/01
ITALY BTPS 0.95 12/01/31		国	債	証	券	0.9500		1,700		1,400			227,412		2031/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30		国	債	証	券	1.6500		2,140		1,904			309,105		2030/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/32		国	債	証	券	2.5000		1,340		1,224			198,827		2032/12/01
ITALY BTPS 3.85 12/15/29		国	債	証	券	3.8500		1,700		1,740			282,518		2029/12/15
ITALY BTPS 2.65 12/01/27		国	債	証	券	2.6500		1,720		1,688			274,059		2027/12/01
小	計	—			—		122,640		116,425			18,900,577		—	
(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		640		298			48,521		2052/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31		国	債	証	券	0.7500		600		524			85,162		2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47		国	債	証	券	1.3750		380		276			44,937		2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26		国	債	証	券	0.5000		460		438			71,143		2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34		国	債	証	券	1.1250		480		407			66,172		2034/04/15
FINLAND 2.75 04/15/38		国	債	証	券	2.7500		370		356			57,931		2038/04/15
FINLAND 0.5 04/15/43		国	債	証	券	0.5000		380		239			38,880		2043/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36		国	債	証	券	0.1250		280		199			32,347		2036/04/15
FINLAND 1.375 04/15/27		国	債	証	券	1.3750		210		201			32,734		2027/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25		国	債	証	券	4.0000		220		222			36,135		2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28		国	債	証	券	2.7500		320		321			52,181		2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42		国	債	証	券	2.6250		330		309			50,246		2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29		国	債	証	券	0.5000		800		711			115,483		2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25		国	債	証	券	0.8750		810		784			127,336		2025/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28		国	債	証	券	0.5000		650		590			95,917		2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27		国	債	証	券	0.5000		400		370			60,186		2027/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40		国	債	証	券	0.2500		290		185			30,036		2040/09/15
FINLAND 1.5 09/15/32		国	債	証	券	1.5000		700		632			102,699		2032/09/15
FINLAND 0.125 09/15/31		国	債	証	券	0.1250		700		576			93,646		2031/09/15
FINLAND 0.0 09/15/30		国	債	証	券	0.0000		510		428			69,583		2030/09/15
FINLAND 0.0 09/15/26		国	債	証	券	0.0000		100		93			15,124		2026/09/15
小	計	—			—		9,630		8,170			1,326,408		—	
(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		310		357			58,062		2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47		国	債	証	券	1.5000		740		549			89,179		2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29		国	債	証	券	0.5000		1,520		1,366			221,903		2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28		国	債	証	券	0.7500		935		867			140,901		2028/02/20
AUSTRIA 2.9 02/20/34		国	債	証	券	2.9000		150		150			24,387		2034/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/31		国	債	証	券	0.0000		1,410		1,165			189,278		2031/02/20
AUSTRIA 2.9 02/20/33		国	債	証	券	2.9000		1,300		1,306			212,033		2033/02/20
AUSTRIA 0.9 02/20/32		国	債	証	券	0.9000		600		519			84,364		2032/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30		国	債	証	券	0.0000		1,180		1,006			163,383		2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26		国	債	証	券	4.8500		1,210		1,257			204,062		2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37		国	債	証	券	4.1500		1,010		1,131			183,652		2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51		国	債	証	券	0.7500		590		344			55,892		2051/03/20

銘	柄	当			期		末						
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日
(ユーロ…オーストリア)				%		千ユーロ		千ユーロ		千円			
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国	債	証	券	0.7000	410		185		30,075	2071/04/20		
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国	債	証	券	0.5000	1,340		1,251		203,166	2027/04/20		
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国	債	証	券	2.4000	870		832		135,183	2034/05/23		
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国	債	証	券	1.8500	590		464		75,354	2049/05/23		
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国	債	証	券	0.8500	310		140		22,859	2120/06/30		
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国	債	証	券	3.1500	550		552		89,772	2044/06/20		
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国	債	証	券	6.2500	615		684		111,049	2027/07/15		
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国	債	証	券	2.0000	460		451		73,309	2026/07/15		
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国	債	証	券	2.1000	390		295		47,998	2117/09/20		
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国	債	証	券	0.7500	1,330		1,263		205,073	2026/10/20		
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国	債	証	券	1.2000	890		864		140,395	2025/10/20		
AUSTRIA 3.15 10/20/53	国	債	証	券	3.1500	420		423		68,799	2053/10/20		
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国	債	証	券	0.2500	840		598		97,092	2036/10/20		
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国	債	証	券	0.0000	450		271		44,131	2040/10/20		
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国	債	証	券	0.0000	620		547		88,955	2028/10/20		
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国	債	証	券	1.5000	190		113		18,478	2086/11/02		
小	計	—	—	—	—	21,230		18,965		3,078,798	—		
合	計	—	—	—	—	—		—		256,938,107	—		

■投資信託財産の構成

2024年 2月21日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額		比 率	
公 社 債	千円		%	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	256,938,107		98.3	
投 資 信 託 財 産 総 額	4,534,468		1.7	
	261,472,575		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、259,685,707千円、99.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年 2月21日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝150.16円、1 カナダ・ドル＝111.02円、1 オーストラリア・ドル＝98.41円、1 シンガポール・ドル＝111.73円、1 ニュージーランド・ドル＝92.63円、1 イギリス・ポンド＝189.58円、1 イスラエル・シェケル＝40.76円、1 デンマーク・クローネ＝21.78円、1 ノルウェー・クローネ＝14.33円、1 スウェーデン・クローナ＝14.51円、1 メキシコ・ペソ＝8.803円、1 オフショア・人民元＝20.841円、1 マレーシア・リンギット＝31.284円、1 ポーランド・ズロチ＝37.609円、1 ユーロ＝162.34円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日)現在

項 目		当 期 末
(A) 資 産	産 等	262,047,572,911円
コ ー ル ・ 公 司 債 等	債 (評価額)	2,571,862,881
未 収 入 金 利	入 利 費	256,938,107,694
前 払 費 用	金 息 用	575,027,153
(B) 負 債	債 金	1,747,978,124
未 払 金	金 金	214,597,059
未 払 金	金 金	1,654,049,105
(C) 純 資 産	金 金	1,628,558,105
元 本	金 金	25,491,000
次 元 益	金 金	260,393,523,806
(D) 受 益	金 金	112,140,675,109
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	金 金	148,252,848,697
	金 金	112,140,675.109円
	金 金	23,220円

(注1) 期首元本額 92,568,430,085円
 追加設定元本額 57,122,203,229円
 一部解約元本額 37,549,958,205円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M 外国債券バッシブ・ファンド	6,936,625,396円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,145,444円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	13,898,297円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	33,055,375円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,463,237円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,934,640円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,209,559円
たわらノーロード 先進国債券	20,317,116,345円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	129,335円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (8資産均等型)	3,175,860,175円
たわらノーロード バランス (堅実型)	70,372,889円
たわらノーロード バランス (標準型)	393,159,511円
たわらノーロード バランス (積極型)	90,074,981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)	17,547,319円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	1,061,778,662円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	1,874,531,468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)	939,477,666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)	721,685,160円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,181,174円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	12,367,147円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	192,544,517円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	20,620,422円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	38,634,144円
D I A M 外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,881,458,772円
One DC 先進国債券インデックスファンド	1,443,766,551円
One グローバルバランス	60,758,637円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>1安定型	734,747,927円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,430,100,443円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,916,905,681円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	415,782,480円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	822,838,550円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	23,358,394円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	887,363,869円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	15,215,627円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	159,329,380円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	160,868,965円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	260,318,009円
クルーズコントロール	1,073,014,665円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	854,009,676円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	699,203,724円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,400,751円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	488,705,414円
One グローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	5,190,355円

One グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	95,009,306円
D I A M バッシブ資産分散ファンド	989,890,513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)	237,386,300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)	238,317,641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)	95,585,889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)	143,381,639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)	544,565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)	621,159,184円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	543,853,224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)	211,165,647円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	866,888,247円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	634,044,700円
D I A M 加替マルチヘッジ型外国債券バッシブファンド (適格機関投資家向け)	4,747,484,094円
D I A M 外国債券バッシブファンド (適格機関投資家向け)	1,364,728,567円
外国債券バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,512,206,226円
先進国債券バッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,272,436,982円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	222,937,463円
D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	43,680,338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)	393,718,174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)	322,665,524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)	208,816,275円
D I A M 国際分散/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,704,671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)	20,619,600円
D I A M 国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,524,169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)	51,265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)	1,512,264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)	33,413,721円
D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,252,683,690円
D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,244,567,605円
D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,359,122,210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)	50,385,127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)	100,205,864円
D I A M アクアグローバル・バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,142,198,851円
D I A M 世界アセット/バランスファンドVA (適格機関投資家向け)	202,876,714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)	155,039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)	199,846,920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)	259,826,276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)	336,700,092円
D I A M 世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	33,520,161円
動的パッケージファンド<DC年金>	48,713,270円
コア資産形成ファンド	24,325,247円
たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	4,593,798,614円
たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	12,277,305,584円
M H A M 動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	5,666,776,191円
M H A M 外国債券バッシブファンド [適格機関投資家限定]	4,945,479,083円
期末元本合計	112,140,675,109円

■損益の状況

当期 自2023年2月22日 至2024年2月21日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収 益	5,766,181,304円
	受		取	利 息	5,766,646,977
	そ	の	他	収 益	5,079
	支		払	利 息	△470,752
(B)	有	価	証	券 売 買 損 益	26,829,583,002
	売			買 益	30,605,561,933
	売			買 損	△3,775,978,931
(C)	そ	の	他	費 用	△34,657,163
(D)	当	期	損 益	金(A + B + C)	32,561,107,143
(E)	前	期	繰 越	損 益 金	94,253,940,578
(F)	解	約	差 損 益 金		△43,521,353,795
(G)	追	加	信 託 差 損 益 金		64,959,154,771
(H)	合		計(D + E + F + G)		148,252,848,697
	次	期	繰 越 損 益 金(H)		148,252,848,697

(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。