

○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	無期限	
運 用 方 針	<ul style="list-style-type: none"><li>・日本を除く世界の主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とした「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券に投資し、また実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことにより、中長期的にFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。</li><li>・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。</li><li>・外貨建資産およびマザーファンド受益証券組入れに伴う実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行います。</li></ul>	
主 要 運 用 対 象	ベ ビ ー フ ァ ン ド	外国債券インデックス・マザー・ ファンド受益証券
	マ ザ ー フ ァ ン ド	日本を除く世界主要国の国債、政府 機関債等
組 入 制 限	ベ ビ ー フ ァ ン ド	<ul style="list-style-type: none"><li>・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。</li><li>・公社債への実質投資割合には制限を設けません。</li><li>・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li><li>・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</li></ul>
	マ ザ ー フ ァ ン ド	<ul style="list-style-type: none"><li>・公社債への投資割合には制限を設けません。</li><li>・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li><li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li></ul>
分 配 方 針	<p>毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。</p> <p>①分配対象額の範囲 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入および売買益(評価益を含みます)等全額とします。</p> <p>②分配方針 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。</p> <p>③留保益の運用方針 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>	

# STATE STREET GLOBAL ADVISORS

## ステート・ストリート 先進国債券インデックス・ オープン(為替ヘッジあり)

### 第9期運用報告書(全体版) (決算日2025年2月20日)

#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、「ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)」は、2025年2月20日に第9期の決算を行いましたので、運用状況をご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間 (営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス [www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

◎最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			<ベンチマーク> FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジベース)		債 券 組入比率	債 券 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 み 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
5期('21年 2月22日)	10,553	0	0.9	10,789	1.4	100.5	－	9,380
6期('22年 2月21日)	10,108	0	△ 4.2	10,371	△ 3.9	100.0	－	13,679
7期('23年 2月20日)	8,715	0	△ 13.8	8,966	△ 13.6	101.5	－	14,329
8期('24年 2月20日)	8,452	0	△ 3.0	8,715	△ 2.8	100.9	－	6,664
9期('25年 2月20日)	8,336	0	△ 1.4	8,617	△ 1.1	96.7	－	6,637

(注1) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営される債券インデックスです。なおファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化しています。

(注2) 先物比率＝買建比率－売建比率

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		<ベンチマーク> FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジベース)		債 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
'24年 2月20日	8,452	－	8,715	－	100.9	－
2月末	8,452	0.0	8,715	0.0	101.5	－
3月末	8,504	0.6	8,769	0.6	99.0	－
4月末	8,339	△ 1.3	8,600	△ 1.3	102.1	－
5月末	8,316	△ 1.6	8,583	△ 1.5	100.5	－
6月末	8,397	△ 0.7	8,664	△ 0.6	100.9	－
7月末	8,461	0.1	8,740	0.3	94.9	－
8月末	8,538	1.0	8,817	1.2	94.6	－
9月末	8,598	1.7	8,878	1.9	98.4	－
10月末	8,413	△ 0.5	8,683	△ 0.4	103.6	－
11月末	8,465	0.2	8,745	0.3	96.7	－
12月末	8,338	△ 1.3	8,613	△ 1.2	103.1	－
'25年 1月末	8,361	△ 1.1	8,628	△ 1.0	96.7	－
(期 末)						
'25年 2月20日	8,336	△ 1.4	8,617	△ 1.1	96.7	－

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営される債券インデックスです。なおファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化しています。

(注3) 先物比率＝買建比率－売建比率

(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

当期の運用実績

(2024年2月21日から2025年2月20日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)で、前期末の基準価額にあわせて委託会社が独自に指数化したものです。

決算期	期首基準価額 (分配落ち)	期末基準価額 (分配落ち)	分配金	基準価額 騰落率	ベンチマーク 騰落率
第9期	8,452円	8,336円	0円	-1.4%	-1.1%

当期末の基準価額は8,336円となり、前期末の8,452円に比べて116円の下落となりました。

## 基準価額の変動要因

ベンチマーク(FTSE 世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境」をご参照ください。

## ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-1.4%となり、ベンチマークの騰落率(-1.1%)を0.2%下回りました。主な要因は、以下の通りです。

### 【ベンチマークとの差異の要因】

ベンチマーク騰落率との差異は運用管理コストや売買コスト等が理由として挙げられます。

## 収益分配金

当期の収益分配金は基準価額の水準、市況動向などを勘案した結果、見送りとしております。また収益分配に充てず信託財産に留保した収益は、特に制限を設けず、元本部分と同様の運用を行う方針です。

## 投資環境

(2024年2月21日から2025年2月20日まで)

### 米国債券市場

米国債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

序盤に底堅い米景気や根強いインフレを受けた米利下げ先送り観測から債券が売られました。その後は労働需給の緩和やインフレ鈍化を受けた米利下げ観測を背景に金利は低下基調で推移しましたが、期の後半、米利下げペース鈍化懸念や米次期政権の政策がインフレ圧力を高めるとの見方から債券が売られました。

米国10年国債利回りは前期末から0.23%上昇の4.51%となりました。

#### 米国10年国債利回りの推移



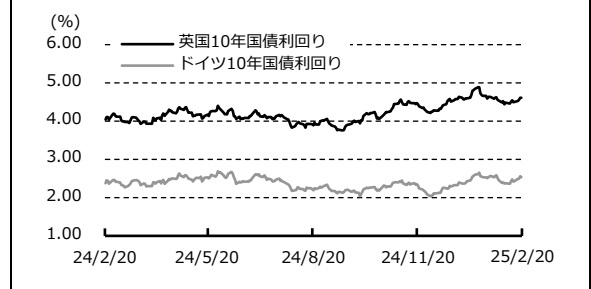
### 欧州債券市場

欧州債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

序盤に米利下げ先送り観測を受けた米長期金利の上昇や欧州景気への懸念後退を背景に債券が売られました。その後は米利下げ観測を受けた米長期金利の低下や欧州の追加利下げ観測が相場を支える中、金利は低下基調で推移しましたが、期の後半、米長期金利上昇やドイツ政治の先行き不透明感などを受けて債券が売られました。

独10年国債利回りは前期末から0.16%上昇の2.53%、英10年国債利回りは前期末から0.57%上昇の4.61%となりました。

#### 英独10年国債利回りの推移

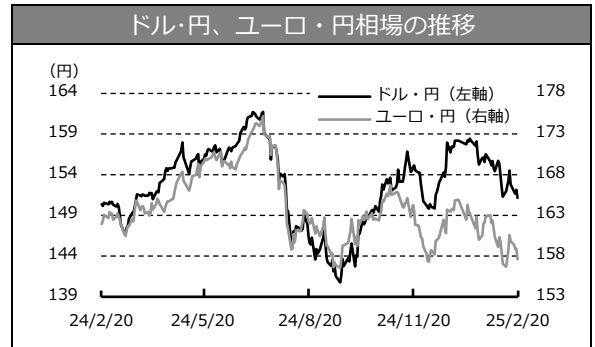


## 為替市況

為替相場は、米ドルに対して円安、ユーロに対しては円高となりました。

ドル・円相場は、序盤に米利下げ先送り観測から円が売られる展開となりましたが、その後は米利下げ観測などを背景に円高が進みました。期の後半には米次期政権の政策がインフレ圧力を高めるとの見方などから米長期金利が上昇する中、円安が進みましたが、期末にかけて米長期金利低下や日銀の利上げ観測を受けて円高が進行しました。円は対米ドルで前期末の150円台から151円台に下落しました。

ユーロ・円相場は、中盤まではドル円と同様の展開となりましたが、期の後半、欧州の景気懸念や利下げ観測、米関税政策への警戒感が重荷となる中、円高・ユーロ安が進行しました。円は対ユーロで前期末の161円台から157円台に上昇しました。



## 運用の概況

(2024年2月21日から2025年2月20日まで)

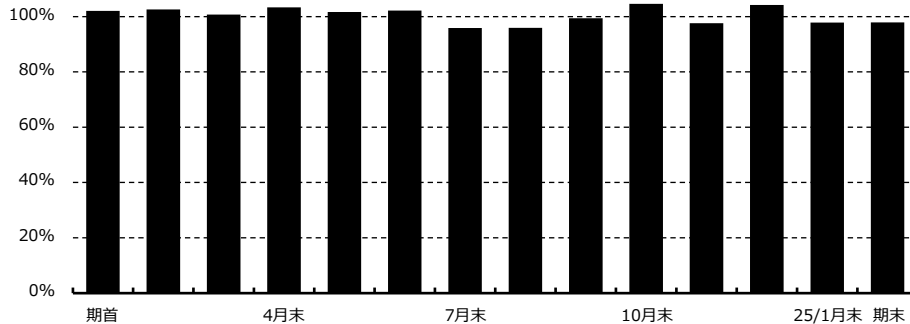
当ファンドは「外国債券インデックス・マザー・ファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象とし、実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことにより、中長期的にFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

マザーファンドは、日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とし、中長期的にFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本的な運用方針としています。公社債への投資は原則として高位を維持し、外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

### マザーファンドの組入状況

当期も、設定・解約に伴う一時的な増減を除き、マザーファンドを高位に組み入れました。

マザーファンド組入比率の推移



## 今後の運用方針

今後も引き続き、マザーファンドを通じて、主として日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等に投資するとともに、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行うことで、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)に連動する投資成果を目指します。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2024年2月21日～2025年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	8,431円	－	期中の平均基準価額です。
(a) 信 託 報 酬	6円	0.066%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 消費税は報告日の税率を採用しています。
（投 信 会 社）	（ 2）	(0.022)	委託した資金の運用の対価
（販 売 会 社）	（ 1）	(0.011)	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、購入後の 情報提供等の対価
（受 託 会 社）	（ 3）	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	5	0.058	(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）	（ 4）	(0.047)	・ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び 資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	（ 1）	(0.011)	・ 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	（ 0）	(0.000)	・ その他は、LEI支払手数料、金銭信託手数料及び信託事務の処理等に要 するその他の諸費用
合 計	11円	0.124%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により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。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

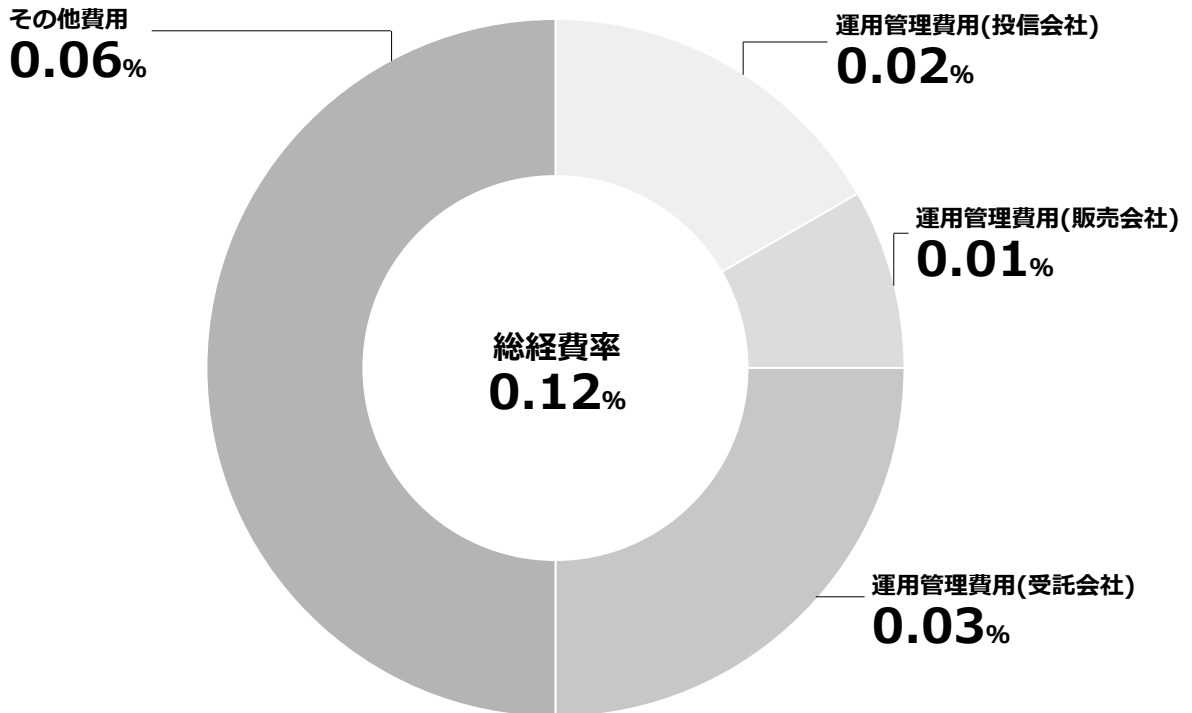
(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。



(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(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)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**0.12%**です。



(注 1) 費用は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、売買委託手数料及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) 費用はマザーファンドが支払った費用を含みます。

(注 5) 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は異なります。

◎売買および取引の状況('24年2月21日から'25年2月20日まで)

○親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス・マザー・ファンド	597,805	1,797,723	761,534	2,301,252

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('24年2月21日から'25年2月20日まで)

○公社債(外国債券インデックス・マザー・ファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
CHINESE GOVERNMENT BOND 1.99% 26/3/15(中国)	994,678	US TREASURY N/B 3.875% 26/1/15(アメリカ)	905,667
US TREASURY N/B 3.875% 26/1/15(アメリカ)	750,638	US TREASURY N/B 3.875% 25/4/30(アメリカ)	903,241
US TREASURY N/B 4.25% 29/2/28(アメリカ)	722,685	US TREASURY N/B 2.125% 25/5/15(アメリカ)	803,995
US TREASURY N/B 4.25% 25/10/15(アメリカ)	715,457	US TREASURY N/B 2.625% 25/3/31(アメリカ)	755,448
US TREASURY N/B 4.875% 26/4/30(アメリカ)	676,044	US TREASURY N/B 4.25% 25/10/15(アメリカ)	753,346
CHINESE GOVERNMENT BOND 1.91% 29/7/15(中国)	557,398	US TREASURY N/B 3% 25/9/30(アメリカ)	745,771
US TREASURY N/B 1.625% 26/5/15(アメリカ)	547,261	US TREASURY N/B 0.5% 25/3/31(アメリカ)	726,071
US TREASURY N/B 4.375% 34/5/15(アメリカ)	546,614	CHINESE GOVERNMENT BOND 2.24% 25/5/25(中国)	695,119
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.28% 25/11/25(中国)	541,918	US TREASURY N/B 2.875% 25/7/31(アメリカ)	663,958
US TREASURY N/B 4.25% 26/12/31(アメリカ)	528,975	CHINESE GOVERNMENT BOND 1.99% 26/3/15(中国)	639,857

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれていません)で、外国公社債は各月末(決算日の属する月については決算日)の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金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('24年2月21日から'25年2月20日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

※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('25年2月20日現在)

○親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス・マザー・ファンド	2,341,135	2,177,406	6,495,856

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における外国債券インデックス・マザー・ファンド全体の口数は28,704,560千口です。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('25年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス・マザー・ファンド	6,495,856	94.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	382,401	5.6
投 資 信 託 財 産 総 額	6,878,257	100.0

(注1) 外貨建資産は、当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、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=151.13円、1カナダドル=106.22円、1メキシコペソ=7.391円、1ユーロ=157.60円、1英ポンド=190.30円、1スウェーデンクローナ=14.10円、1ノルウェークローネ=13.59円、1デンマーククローネ=21.13円、1ポーランドズロチ=37.717円、1オーストラリアドル=95.97円、1ニュージーランドドル=86.22円、1シンガポールドル=112.64円、1マレーシアリンギット=34.0229円、1人民元=20.7582円、1イスラエルシェケル=42.6259円、1オフショア人民元=20.7557円です。

(注2) 外国債券インデックス・マザー・ファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(85,637,892千円)の投資信託財産総額(85,655,120千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

( '25年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	35,108,672,957
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	12,656,274
外国債券インデックス・マザー・ファンド(評価額)	6,495,856,671
未 収 入 金	28,600,159,865
未 収 利 息	147
(B) 負 債	28,470,947,017
未 払 金	28,456,736,761
未 払 解 約 金	11,634,453
未 払 信 託 報 酬	2,207,876
そ の 他 未 払 費 用	367,927
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	6,637,725,940
元 本	7,963,088,844
次 期 繰 越 損 益 金	△ 1,325,362,904
(D) 受 益 権 総 口 数	7,963,088,844口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	8,336円

- (注1) 期首元本額 7,885,305,526円  
期中追加設定元本額 2,317,144,781円  
期中一部解約元本額 2,239,361,463円  
(注2) 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は1,325,362,904円です。

◎損益の状況

当期(自'24年2月21日 至'25年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	7,942
受 取 利 息	8,728
支 払 利 息	△ 786
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 78,459,205
売 買 益	5,320,734,604
売 買 損	△ 5,399,193,809
(C) 信 託 報 酬 等	△ 5,124,328
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 83,575,591
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 600,362,559
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 641,424,754
(配 当 等 相 当 額)	( 1,005,874,075)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,647,298,829)
(G) 計 (D+E+F)	△ 1,325,362,904
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 1,325,362,904
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 641,424,754
(配 当 等 相 当 額)	( 1,010,329,802)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,651,754,556)
分 配 準 備 積 立 金	444,743,611
繰 越 損 益 金	△ 1,128,681,761

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。  
(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。  
(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越損益金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。  
(注4) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。  
(注5) 分配金の計算過程

A	費用控除後の配当等収益	169,966,081 円
B	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0 円
C	収益調整金	1,010,329,802 円
D	分配準備積立金	274,777,530 円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,455,073,413 円
F	分配対象収益(1 万口当たり)	1,827 円
G	分配金	0 円
H	分配金(1 万口当たり)	0 円

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目		第9期 (2024年2月21日～ 2025年2月20日)
当期分配金		－円
(対基準価額比率)		－%
当期の収益		－円
当期の収益以外		－円
翌期繰越分配対象額		1,827円

- (注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
- (注2) 当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## 外国債券インデックス・マザー・ファンド

### 第24期 運用報告書 (決算日2025年2月20日)

外国債券インデックス・マザー・ファンドの第24期の運用状況をご報告させていただきます。

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。</li> <li>・ 公社債への投資は原則として高位を維持します。</li> <li>・ 外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。</li> </ul>
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界主要国の国債、政府機関債など
組 入 制 限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 公社債への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・ 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>・ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

## ◎最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		＜ベンチマーク＞ FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 券 組入比率	債 券 先物比率	純 資 産 総 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
	円	%		%	%	%	百万円
20期('21年 2月22日)	24,865	2.1	25,103	2.3	99.0	－	139,557
21期('22年 2月21日)	25,264	1.6	25,509	1.6	99.6	－	113,258
22期('23年 2月20日)	25,315	0.2	25,566	0.2	99.0	－	100,006
23期('24年 2月20日)	29,054	14.8	29,349	14.8	98.9	－	93,228
24期('25年 2月20日)	29,833	2.7	30,161	2.8	98.8	－	85,634

(注1) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。なおファンド設定日を10,000として委託会社が独自に円換算および合成して指数化しています。円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注2) 先物比率＝買建比率－売建比率

## ◎当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		＜ベンチマーク＞ FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
'24年 2月20日	29,054	－	29,349	－	98.9	－
2月末	29,209	0.5	29,512	0.6	98.9	－
3月末	29,579	1.8	29,888	1.8	98.3	－
4月末	30,132	3.7	30,436	3.7	98.8	－
5月末	30,297	4.3	30,614	4.3	98.9	－
6月末	31,355	7.9	31,683	8.0	98.8	－
7月末	30,199	3.9	30,516	4.0	99.0	－
8月末	29,431	1.3	29,738	1.3	98.6	－
9月末	29,479	1.5	29,775	1.5	99.0	－
10月末	30,723	5.7	31,043	5.8	99.1	－
11月末	30,089	3.6	30,408	3.6	99.0	－
12月末	31,025	6.8	31,351	6.8	98.9	－
'25年 1月末	30,398	4.6	30,726	4.7	98.9	－
(期 末)						
'25年 2月20日	29,833	2.7	30,161	2.8	98.8	－

(注1) 騰落率は期首比です。

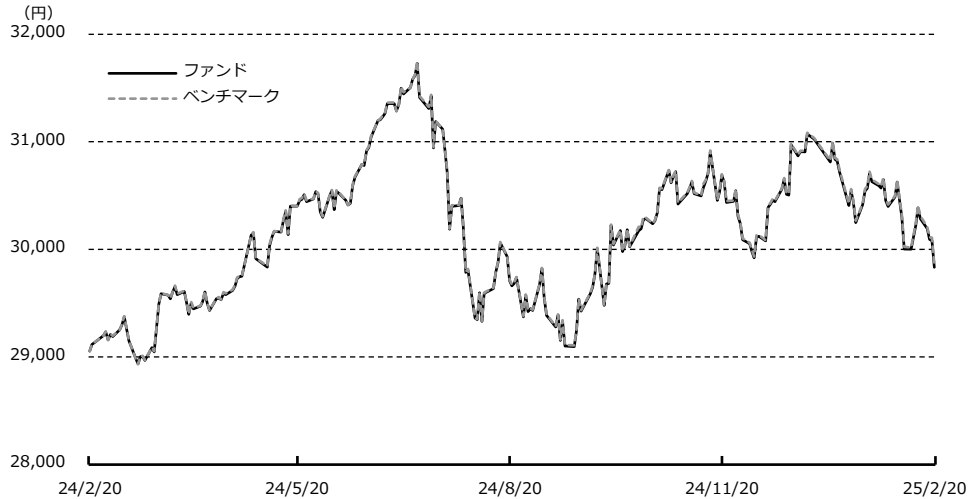
(注2) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。なおファンド設定日を10,000として委託会社が独自に円換算および合成して指数化しています。円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注3) 先物比率＝買建比率－売建比率

当期の運用実績

(2024年2月21日から2025年2月20日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)で、前期末の基準価額にあわせて指数化しています。

当期末の基準価額は29,833円となり、前期末の29,054円に比べて779円の上昇となりました。



## 基準価額の変動要因

ベンチマーク(FTSE 世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境」をご参照ください。

## ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+2.7%となり、ベンチマークの騰落率(+2.8%)とほぼ同水準となりました。主な要因は以下の通りです。

### 【ベンチマークとの差異の要因】

ベンチマーク騰落率との差異は運用管理コストや売買コスト等が理由として挙げられます。

## 投資環境

(2024年2月21日から2025年2月20日まで)

## 米国債券市場

米国債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

序盤に底堅い米景気や根強いインフレを受けた米利下げ先送り観測から債券が売られました。その後は労働需給の緩和やインフレ鈍化を受けた米利下げ観測を背景に金利は低下基調で推移しましたが、期の後半、米利下げペース鈍化懸念や米次期政権の政策がインフレ圧力を高めるとの見方から債券が売られました。

米国10年国債利回りは前期末から0.23%上昇の4.51%となりました。

## 米国10年国債利回りの推移



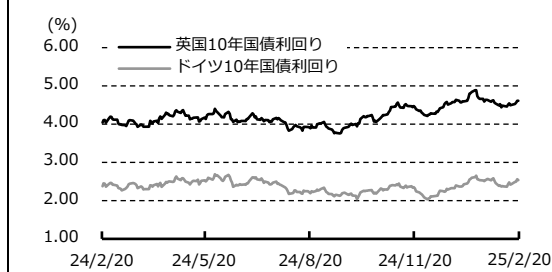
## 欧州債券市場

欧州債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

序盤に米利下げ先送り観測を受けた米長期金利の上昇や欧州景気への懸念後退を背景に債券が売られました。その後は米利下げ観測を受けた米長期金利の低下や欧州の追加利下げ観測が相場を支える中、金利は低下基調で推移しましたが、期の後半、米長期金利上昇やドイツ政治の先行き不透明感などを受けて債券が売られました。

独10年国債利回りは前期末から0.16%上昇の2.53%、英10年国債利回りは前期末から0.57%上昇の4.61%となりました。

## 英独10年国債利回りの推移

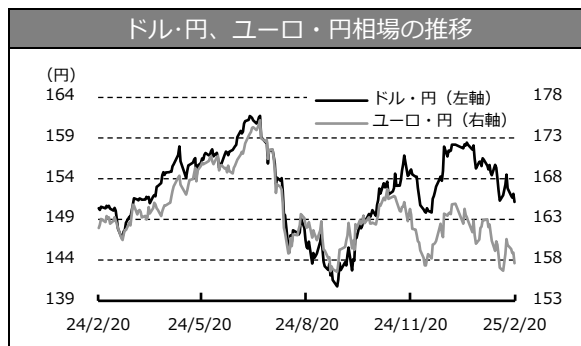


## 為替市況

為替相場は、米ドルに対して円安、ユーロに対しては円高となりました。

ドル・円相場は、序盤に米利下げ先送り観測から円が売られる展開となりましたが、その後は米利下げ観測などを背景に円高が進みました。期の後半には米次期政権の政策がインフレ圧力を高めるとの見方などから米長期金利が上昇する中、円安が進みましたが、期末にかけて米長期金利低下や日銀の利上げ観測を受けて円高が進行しました。円は対米ドルで前期末の150円台から151円台に下落しました。

ユーロ・円相場は、中盤まではドル円と同様の展開となりましたが、期の後半、欧州の景気懸念や利下げ観測、米関税政策への警戒感が重荷となる中、円高・ユーロ安が進行しました。円は対ユーロで前期末の161円台から157円台に上昇しました。



## 運用の概況

(2024年2月21日から2025年2月20日まで)

当マザーファンドは、主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債を主な投資対象とし、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に連動する投資成果を目指した運用を行うことを基本的な運用方針としています。公社債への投資は原則として高位を維持し、外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

当期は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の収益率を捉える目的で、層化抽出法の発想に従って、ファンドの国別通貨別の配分や、各国別とファンド全体のデュレーション(金利感応度)、債券の満期構成などをベンチマークに合致させるように努めつつ、インデックス構成国の国債に分散投資しました。

インデックスの構成銘柄変更のタイミングに合わせて、各月末にファンドのリスク特性をベンチマークに合わせるべくリバランス(銘柄の入れ替え)を行うとともに、月中における資金流入出に対応した取引や、ファンドで受け取った利金の再投資も行いました。

組入銘柄数は、550銘柄前後で期を通じて安定的に運用を行いました。また、債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

## 今後の運用方針

今後も引き続き、主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債などに投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2024年2月21日~2025年2月20日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平 均 基 準 価 額	30,159円	-	期中の平均基準価額です。
(a) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 )  ( そ の 他 )	14円 ( 14 )  ( 0 )	0.047% (0.047)  (0.000)	(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、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・ その他は、LEI支払手数料、金銭信託手数料及び信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	14円	0.047%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により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。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('24年2月21日から'25年2月20日まで)

○公社債

			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 83,291	千米ドル 110,274
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 5,631	千カナダドル 6,885
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 14,392	千メキシコペソ 14,345
	ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ
	ド イ ツ	国 債 証 券	6,164	11,711
	イ タ リ ア	国 債 証 券	6,312	12,989
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	6,502	13,534
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	1,228	2,778
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	4,093	8,605
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	1,001	2,540
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	627	1,631
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	522	836
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	203	1,080
	ポ ル ト ガ ル	国 債 証 券	3,514	339
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千英ポンド 6,487	千英ポンド 8,187
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 880	千スウェーデンクローナ 4,535
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 1,601	千ノルウェークローネ 3,669
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 303	千デンマーククローネ 3,487
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 4,372	千ポーランドズロチ 4,869
国	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 1,194	千オーストラリアドル 3,163
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ニュージーランドドル 713	千ニュージーランドドル 526
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 620	千シンガポールドル 1,161
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 202	千マレーシアリンギット 2,480
	中 国	国 債 証 券	千人民元 257,009	千人民元 181,582
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 2,118	千イスラエルシェケル 2,611

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 地域は発行通貨によって区分しています。ただし、ユーロ建ての外国公社債は発行体の国籍によって区分しています。以下同じです。

(注4) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄(’24年2月21日から’25年2月20日まで)

○公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
CHINESE GOVERNMENT BOND 1.99% 26/3/15(中国)	994,678	US TREASURY N/B 3.875% 26/1/15(アメリカ)	905,667
US TREASURY N/B 3.875% 26/1/15(アメリカ)	750,638	US TREASURY N/B 3.875% 25/4/30(アメリカ)	903,241
US TREASURY N/B 4.25% 29/2/28(アメリカ)	722,685	US TREASURY N/B 2.125% 25/5/15(アメリカ)	803,995
US TREASURY N/B 4.25% 25/10/15(アメリカ)	715,457	US TREASURY N/B 2.625% 25/3/31(アメリカ)	755,448
US TREASURY N/B 4.875% 26/4/30(アメリカ)	676,044	US TREASURY N/B 4.25% 25/10/15(アメリカ)	753,346
CHINESE GOVERNMENT BOND 1.91% 29/7/15(中国)	557,398	US TREASURY N/B 3% 25/9/30(アメリカ)	745,771
US TREASURY N/B 1.625% 26/5/15(アメリカ)	547,261	US TREASURY N/B 0.5% 25/3/31(アメリカ)	726,071
US TREASURY N/B 4.375% 34/5/15(アメリカ)	546,614	CHINESE GOVERNMENT BOND 2.24% 25/5/25(中国)	695,119
CHINESE GOVERNMENT BOND 2.28% 25/11/25(中国)	541,918	US TREASURY N/B 2.875% 25/7/31(アメリカ)	663,958
US TREASURY N/B 4.25% 26/12/31(アメリカ)	528,975	CHINESE GOVERNMENT BOND 1.99% 26/3/15(中国)	639,857

(注1) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれていません)で、外国公社債は各月末(決算日の属する月については決算日)の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金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等(’24年2月21日から’25年2月20日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

※ 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('25年2月20日現在)

## ○外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 額	評 価 額		組 入 率	うちBB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	千米ドル 298,040	千米ドル 265,520	千円 40,128,071	% 46.9	% -	% 20.0	% 17.0	% 9.9
カ ナ ダ	千カナダドル 16,710	千カナダドル 15,976	1,696,984	2.0	-	1.2	0.3	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 97,400	千メキシコペソ 89,333	660,262	0.8	-	0.4	0.3	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ						
ド イ ツ	31,890	30,544	4,813,830	5.6	-	3.1	1.6	0.9
イ タ リ ア	36,440	35,901	5,658,053	6.6	-	3.8	2.0	0.9
フ ラ ン ス	42,340	38,771	6,110,350	7.1	-	4.1	2.2	0.9
オ ラ ン ダ	7,330	6,696	1,055,397	1.2	-	0.8	0.4	0.0
ス ペ イ ン	24,470	23,498	3,703,428	4.3	-	2.5	1.3	0.5
ベ ル ギ ー	8,930	8,237	1,298,295	1.5	-	1.1	0.4	0.1
オーストリア	6,400	5,780	910,942	1.1	-	0.6	0.3	0.1
フィンランド	3,050	2,664	419,899	0.5	-	0.3	0.1	0.1
アイルランド	2,765	2,462	388,121	0.5	-	0.3	0.1	0.0
ポルトガル	3,440	3,137	494,510	0.6	-	0.4	0.2	-
イ ギ リ ス	千英ポンド 27,320	千英ポンド 22,866	4,351,452	5.1	-	3.7	1.0	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 9,910	千スウェーデンクローナ 9,960	140,440	0.2	-	0.1	0.1	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 10,350	千ノルウェークローネ 9,627	130,837	0.2	-	0.1	0.0	0.0
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 9,180	千デンマーククローネ 8,681	183,442	0.2	-	0.1	0.1	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 13,350	千ポーランドズロチ 12,468	470,283	0.5	-	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 11,990	千オーストラリアドル 10,684	1,025,352	1.2	-	0.9	0.3	0.0
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 3,245	千ニュージーランドドル 2,755	237,550	0.3	-	0.2	0.1	-
シンガポール	千シンガポールドル 2,890	千シンガポールドル 2,857	321,844	0.4	-	0.3	0.1	-
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 12,130	千マレーシアリンギット 12,645	430,229	0.5	-	0.4	0.0	0.1
中 国	千人民元 438,300	千人民元 466,815	9,690,252	11.3	-	5.0	3.8	2.6
イ ス ラ エ ル	千イスラエルシェケル 7,565	千イスラエルシェケル 7,213	307,499	0.4	-	0.2	0.2	-
合 計	-	-	84,627,332	98.8	-	49.6	32.0	17.2

(注1) 外貨建金額は、原則として金融商品取引業者、価格情報会社等より入手した時価により評価したものです。また、邦貨換算金額は、当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、当期末の純資産総額に対する邦貨換算金額(評価額)の比率です。

(注3) 格付については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注4) 金額の単位未満は切り捨てています。

## ○外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

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)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	3,550	3,415	516,140	2026/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	700	607	91,810	2043/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,000	687	103,860	2046/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	520	522	78,955	2036/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.25	1,400	1,521	229,921	2030/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	2,800	2,756	416,651	2026/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	3,000	2,922	441,736	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	4,000	3,928	593,652	2026/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,300	2,249	339,968	2026/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.75	3,400	3,270	494,251	2026/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	4.875	2,200	2,214	334,654	2026/ 4/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	3,800	3,679	556,078	2026/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	3,900	3,725	563,044	2026/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	3,500	3,361	508,003	2026/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	3,500	3,351	506,515	2026/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,000	3,837	579,937	2026/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	2,200	2,084	315,004	2026/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	1,600	1,595	241,137	2026/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	3,500	3,497	528,645	2026/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	4,800	4,552	688,075	2027/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	3,500	3,365	508,643	2027/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	4,100	3,852	582,188	2027/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	4,000	3,838	580,126	2027/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,800	1,735	262,310	2027/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	2,000	1,832	276,874	2027/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	1,200	1,202	181,717	2027/ 7/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	3,300	3,003	453,882	2027/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,000	1,905	287,914	2027/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	3,200	3,111	470,184	2027/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.375	3,800	3,436	519,421	2027/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	1,600	1,583	239,295	2027/10/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.5	1,650	1,492	225,528	2027/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	2,600	2,464	372,385	2027/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	4,300	3,890	587,995	2027/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	2,950	2,660	402,155	2027/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	600	599	90,550	2028/ 1/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	1,900	1,858	280,854	2028/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,300	2,200	332,608	2028/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,700	1,550	234,319	2028/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	2,500	2,451	370,430	2028/ 3/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	3,400	3,253	491,682	2028/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	2,800	2,540	383,922	2028/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	2,600	2,352	355,578	2028/ 6/30



銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	2,300	2,277	344,231	2028/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,500	1,430	216,130	2028/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	600	538	81,415	2028/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.625	1,800	1,817	274,669	2028/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,400	1,259	190,407	2028/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,700	1,629	246,232	2028/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.5	2,400	2,164	327,149	2028/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	350	350	52,955	2028/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,000	895	135,355	2028/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	3,800	3,445	520,723	2029/ 1/31
US TREASURY N/B	国債証券	2.625	3,600	3,374	509,999	2029/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	4,400	4,383	662,504	2029/ 2/28
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	3,000	2,772	419,031	2029/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	600	603	91,170	2029/ 5/31
US TREASURY N/B	国債証券	3.25	2,200	2,103	317,900	2029/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	1,500	1,493	225,676	2029/ 6/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	1,000	985	148,951	2029/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	6,600	5,879	888,594	2029/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	2,300	2,217	335,107	2029/ 9/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.75	2,150	1,914	289,301	2029/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	1,600	1,600	241,826	2029/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	2,650	2,186	330,501	2030/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.625	3,900	3,187	481,725	2030/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	0.875	4,000	3,290	497,335	2030/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	1,500	1,496	226,137	2030/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	3,650	3,027	457,503	2031/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.625	1,500	1,515	228,961	2031/ 4/30
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	4,400	3,731	563,953	2031/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	3,200	3,143	475,020	2031/ 7/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	4,000	3,284	496,414	2031/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	2,500	2,401	362,933	2031/ 8/31
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	2,000	1,962	296,521	2031/10/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,200	986	149,066	2031/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	1,300	1,275	192,693	2031/11/30
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	900	902	136,378	2031/12/31
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	3,250	2,748	415,386	2032/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	3,400	3,067	463,561	2032/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	3,100	2,762	417,443	2032/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	2,000	1,955	295,589	2032/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	1,800	1,681	254,075	2033/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	1,900	1,753	265,072	2033/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	1,800	1,720	259,983	2033/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	2,550	2,547	385,035	2033/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	2,400	2,307	348,798	2034/ 2/15

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	1,100	1,087	164,340	2034/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	2,600	2,468	373,106	2034/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	2,200	2,150	325,005	2034/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	300	297	44,947	2038/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.5	600	531	80,260	2039/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	500	478	72,315	2039/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	750	725	109,588	2039/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	500	481	72,831	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,000	609	92,177	2040/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	900	816	123,440	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.125	900	543	82,173	2040/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	1,000	947	143,142	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,250	783	118,387	2040/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.75	1,000	1,002	151,436	2041/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,400	949	143,495	2041/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,250	896	135,485	2041/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.75	800	708	107,146	2041/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	950	770	116,496	2041/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	800	543	82,101	2041/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	900	727	109,993	2042/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	500	395	59,767	2042/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,200	909	137,412	2042/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	1,100	915	138,416	2042/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	377	56,983	2042/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	300	271	41,097	2042/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	700	557	84,265	2043/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	300	229	34,641	2043/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.875	800	709	107,245	2043/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	300	256	38,713	2043/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	500	473	71,615	2043/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.75	350	347	52,577	2043/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	900	765	115,704	2044/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	400	313	47,350	2044/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	200	182	27,543	2044/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.5	950	664	100,473	2045/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	400	304	46,042	2045/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	900	669	101,167	2045/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	900	682	103,139	2045/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	200	130	19,698	2046/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	800	586	88,585	2046/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	900	672	101,693	2047/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,000	745	112,686	2047/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	354	53,630	2047/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,000	707	106,959	2047/11/15

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	550	407	61,513	2048/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,500	1,133	171,278	2048/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,500	1,104	166,975	2048/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.375	1,770	1,393	210,656	2048/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,200	880	133,055	2049/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	500	357	54,020	2049/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,000	624	94,420	2049/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,700	1,089	164,630	2049/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	2,000	1,171	176,975	2050/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,100	525	79,491	2050/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,200	589	89,154	2050/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.625	600	315	47,669	2050/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	3,350	1,878	283,836	2051/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.375	3,500	2,216	334,935	2051/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,600	921	139,228	2051/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	1.875	2,400	1,334	201,616	2051/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,900	1,159	175,283	2052/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,500	1,054	159,430	2052/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,800	1,298	196,310	2052/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.0	2,100	1,837	277,688	2052/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	3.625	1,100	899	135,877	2053/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.125	1,050	939	142,018	2053/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.75	1,200	1,191	180,017	2053/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.625	400	389	58,907	2054/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.25	850	778	117,701	2054/ 8/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.5	700	669	101,179	2054/11/15
US TREASURY N/B	国債証券	4.375	400	391	59,207	2038/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.0	300	312	47,280	2037/ 5/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.0	2,000	2,034	307,486	2026/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	5.375	500	525	79,346	2031/ 2/15
US TREASURY N/B	国債証券	6.125	300	314	47,538	2027/11/15
小計					40,128,071	
(カナダ)			千カナダドル	千カナダドル		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	410	458	48,707	2029/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	500	588	62,533	2037/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	3,100	3,018	320,644	2026/ 3/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,100	1,082	114,988	2026/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,100	1,057	112,369	2027/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	550	536	56,996	2028/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,260	1,156	122,882	2030/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,500	1,371	145,696	2031/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,710	1,591	169,054	2032/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	750	730	77,576	2033/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	870	858	91,190	2034/ 6/ 1

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	430	431	45,820	2035/ 6/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	230	235	25,053	2045/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	430	387	41,207	2048/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	670	509	54,092	2051/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	620	437	46,438	2053/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	370	326	34,705	2055/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	410	363	38,642	2064/12/ 1
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	700	832	88,383	2033/ 6/ 1
小計					1,696,984	
(メキシコ)			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	11,500	10,483	77,482	2031/ 5/29
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	11,000	10,649	78,712	2026/ 3/ 5
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5	21,500	20,806	153,778	2027/ 6/ 3
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	15,000	14,484	107,058	2029/ 5/31
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5	3,500	3,038	22,454	2033/ 5/26
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	2,500	2,169	16,032	2034/11/23
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	10.0	7,200	7,256	53,633	2036/11/20
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5	7,000	6,141	45,393	2038/11/18
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.75	4,300	3,380	24,984	2042/11/13
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	8,100	6,402	47,321	2047/11/ 7
MEXICAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0	5,800	4,520	33,410	2053/ 7/31
小計					660,262	
(ユーロ)			千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)						
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,790	1,725	271,968	2027/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	800	769	121,225	2027/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	200	200	31,646	2030/ 4/18
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	500	532	83,946	2042/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	710	678	106,964	2046/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,070	1,053	165,978	2026/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,600	1,499	236,291	2028/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,000	927	146,152	2029/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,230	1,115	175,748	2029/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	179	28,217	2030/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	530	83,665	2030/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	873	137,610	2031/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,034	163,009	2031/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,120	965	152,181	2031/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	1,630	1,554	244,959	2032/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6	1,100	1,111	175,144	2033/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2	850	830	130,840	2034/ 2/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	540	85,124	2035/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6	150	146	23,103	2041/ 5/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	730	700	110,358	2044/ 7/ 4

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)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ドイツ)						
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	770	570	89,959	2048/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	451	71,233	2050/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	730	347	54,834	2052/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8	780	631	99,525	2053/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	650	612	96,578	2054/ 8/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	900	974	153,610	2028/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.625	1,300	1,423	224,398	2028/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	680	773	121,899	2037/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	600	707	111,510	2039/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,220	1,448	228,228	2034/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	680	849	133,886	2040/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	750	879	138,541	2031/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	450	530	83,649	2030/ 1/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5	1,350	1,484	233,898	2027/ 7/ 4
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,950	1,890	297,937	2026/ 8/15
(イタリア)						
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	600	612	96,558	2026/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	1,000	1,030	162,470	2037/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	850	951	149,934	2034/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.25	1,000	1,081	170,367	2026/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	800	897	141,388	2039/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.25	1,250	1,382	217,954	2029/11/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	850	990	156,122	2033/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	800	931	146,791	2031/ 5/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	1,900	1,883	296,794	2026/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	1,150	1,128	177,823	2026/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2	1,600	1,592	250,938	2027/ 6/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.05	500	495	78,044	2027/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	3,000	2,954	465,587	2028/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,270	1,359	214,189	2028/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	1,200	1,205	189,940	2028/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	1,650	1,663	262,133	2029/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	1,000	1,028	162,163	2030/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	1,150	1,064	167,720	2030/ 4/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	1,200	1,111	175,094	2030/12/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	700	614	96,852	2031/ 4/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6	430	366	57,781	2031/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.15	200	198	31,342	2031/11/15
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	450	406	64,010	2032/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4	920	987	155,559	2033/ 5/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.45	1,180	1,099	173,257	2033/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2	850	896	141,326	2034/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.85	200	204	32,188	2035/ 2/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.35	700	687	108,318	2035/ 3/ 1

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)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(イタリア)						
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.65	280	279	44,123	2035/ 8/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	900	780	123,014	2036/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.95	800	727	114,684	2038/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	850	951	149,940	2040/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8	870	648	102,267	2041/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	550	600	94,675	2044/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	500	441	69,553	2046/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	550	441	69,553	2047/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	530	478	75,422	2048/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.85	600	573	90,394	2049/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.45	450	332	52,402	2050/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	350	217	34,316	2051/ 9/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	100	104	16,448	2053/10/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8	510	376	59,312	2067/ 3/ 1
ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.15	200	122	19,289	2072/ 3/ 1
(フランス)						
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,050	1,172	184,831	2041/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	570	590	93,106	2060/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	350	342	53,940	2026/ 2/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	970	984	155,086	2026/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,700	1,663	262,245	2026/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,650	1,601	252,416	2027/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	2,850	2,875	453,128	2027/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	2,130	2,014	317,486	2028/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	1,450	1,355	213,664	2028/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,500	1,371	216,177	2029/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	980	862	136,008	2029/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	1,200	1,185	186,796	2030/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	1,875	295,642	2030/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,317	207,602	2031/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,131	178,247	2032/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,170	1,086	171,277	2032/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,150	1,822	287,159	2034/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	950	766	120,836	2036/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	750	607	95,692	2039/ 6/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	920	595	93,844	2040/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6	340	340	53,625	2042/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	200	115	18,161	2044/ 6/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,100	816	128,636	2048/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,080	693	109,373	2050/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	680	331	52,270	2053/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	600	518	81,636	2054/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	480	156	24,726	2072/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,500	1,694	266,994	2035/ 4/25

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(フランス)						
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	1,480	1,645	259,360	2029/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,300	1,541	242,990	2032/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,300	1,199	189,118	2031/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	830	786	123,997	2045/ 5/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	900	953	150,306	2038/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	730	757	119,404	2055/ 4/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,730	1,670	263,245	2026/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	550	325	51,311	2066/ 5/25
(オランダ)						
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	350	388	61,159	2042/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	300	334	52,795	2037/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	200	195	30,797	2026/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	600	579	91,338	2027/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	500	474	74,803	2028/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	400	364	57,466	2029/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	520	456	71,881	2030/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	426	67,215	2031/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	650	644	101,563	2033/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	500	490	77,303	2034/ 7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	380	262	41,423	2038/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	350	249	39,367	2040/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	160	167	26,373	2044/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	540	526	82,944	2047/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	510	240	37,944	2052/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	200	164	26,000	2054/ 1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	670	729	115,019	2028/ 1/15
(スペイン)						
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	1,330	1,309	206,332	2026/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	1,100	1,081	170,393	2027/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	1,100	1,073	169,150	2027/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	1,000	968	152,579	2028/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4	960	925	145,894	2028/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	600	573	90,366	2029/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6	700	637	100,474	2029/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	620	555	87,473	2030/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.95	750	721	113,717	2030/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	1,020	865	136,430	2031/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7	1,600	1,374	216,608	2032/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.35	2,000	1,899	299,439	2033/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.55	200	207	32,655	2033/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	250	255	40,332	2034/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.15	280	278	43,918	2035/ 4/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.85	770	678	106,912	2035/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9	550	574	90,536	2039/ 7/30

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(スペイン)						
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7	750	855	134,801	2041/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	790	528	83,252	2042/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	400	483	76,226	2044/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7	420	354	55,841	2048/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	400	222	35,143	2050/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9	280	190	30,087	2052/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	490	241	38,040	2071/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9	440	390	61,468	2046/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2	500	543	85,608	2037/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9	550	638	100,620	2040/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9	1,470	1,544	243,394	2026/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.15	750	818	128,943	2028/10/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.45	350	319	50,336	2066/ 7/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	800	903	142,351	2029/ 1/31
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	1,250	1,485	234,094	2032/ 7/30
(ベルギー)						
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	450	460	72,641	2026/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	390	376	59,397	2027/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8	250	237	37,389	2028/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	530	495	78,042	2029/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	500	438	69,067	2030/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	280	252	39,792	2031/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0	850	914	144,140	2032/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.35	200	167	26,393	2032/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	450	398	62,829	2033/ 4/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	550	550	86,717	2034/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1	50	49	7,872	2035/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.45	480	393	62,032	2037/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9	200	170	26,841	2038/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	180	116	18,324	2040/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	370	407	64,295	2041/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	250	258	40,804	2045/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6	300	211	33,268	2047/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	220	151	23,874	2050/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	610	447	70,492	2057/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.15	260	179	28,367	2066/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.65	260	98	15,602	2071/ 6/22
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5	750	818	129,015	2028/ 3/28
BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	550	641	101,090	2035/ 3/28
(オーストリア)						
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.85	250	256	40,455	2026/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	180	175	27,679	2026/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	780	744	117,276	2028/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	400	370	58,419	2029/ 2/20



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)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(オーストリア)						
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	264	41,663	2030/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	550	469	74,042	2031/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9	650	654	103,125	2033/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	630	605	95,443	2034/ 5/23
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	250	154	24,302	2040/10/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.15	210	208	32,889	2044/ 6/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	235	173	27,355	2047/ 2/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	360	206	32,587	2051/ 3/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8	95	106	16,733	2062/ 1/26
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	120	69	10,896	2086/ 11/ 2
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1	190	137	21,606	2117/ 9/20
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.85	190	74	11,748	2120/ 6/30
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.15	360	399	63,018	2037/ 3/15
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.25	650	708	111,696	2027/ 7/15
(フィンランド)						
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	400	392	61,838	2026/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	200	202	31,922	2028/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	300	280	44,240	2028/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	170	155	24,501	2029/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	100	99	15,721	2030/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	30	26	4,098	2030/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	230	205	32,380	2031/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	180	152	24,043	2031/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	250	252	39,850	2033/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.125	170	145	23,003	2034/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	260	189	29,818	2036/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	150	96	15,277	2040/ 9/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.625	195	181	28,603	2042/ 7/ 4
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2	60	59	9,451	2045/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	150	107	16,940	2047/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.125	160	72	11,500	2052/ 4/15
FINNISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.95	45	42	6,707	2055/ 4/15
(アイルランド)						
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.35	250	209	33,093	2032/10/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.55	70	47	7,559	2041/ 4/22
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.15	60	59	9,402	2055/10/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7	190	165	26,011	2037/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	84	13,260	2031/10/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4	120	93	14,789	2035/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9	370	354	55,833	2028/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	250	246	38,831	2026/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1	220	208	32,853	2029/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3	90	80	12,746	2033/ 5/15

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)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(アイルランド)						
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.35	210	195	30,878	2031/ 3/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	295	212	33,481	2050/ 5/15
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	220	185	29,225	2045/ 2/18
IRISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4	320	318	50,155	2030/ 5/15
(ポルトガル)						
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7	770	741	116,890	2027/10/15
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.95	300	294	46,443	2029/ 6/15
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3	940	807	127,313	2031/10/17
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.65	400	371	58,503	2032/ 7/16
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.875	420	416	65,646	2034/10/20
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	210	214	33,876	2038/ 6/18
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.15	220	155	24,497	2042/ 4/11
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	100	56	8,825	2052/ 4/12
PORTUGUESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.625	80	79	12,513	2054/ 6/12
小計					24,852,829	
(イギリス)			千英ポンド	千英ポンド		
UK GILT BOND	国債証券	4.25	650	567	108,071	2049/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	510	477	90,873	2042/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.5	950	943	179,568	2034/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	780	727	138,351	2039/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.0	750	614	116,877	2060/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	1.5	1,930	1,862	354,520	2026/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	650	598	113,961	2040/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	3.5	750	599	114,162	2045/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	3.75	470	372	70,912	2052/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	350	336	64,014	2036/ 3/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	800	819	155,917	2030/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	6.0	750	799	152,236	2028/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	0.375	200	161	30,808	2030/10/22
UK GILT BOND	国債証券	0.875	730	630	119,964	2029/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	850	779	148,337	2028/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.625	970	403	76,734	2071/10/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	800	432	82,395	2049/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	1.75	980	468	89,125	2057/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	2.5	820	464	88,322	2065/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	3.5	650	475	90,408	2068/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	4.25	850	751	142,928	2046/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,050	1,041	198,126	2032/ 6/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	1,050	1,055	200,772	2027/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.25	830	713	135,788	2055/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	4.75	600	593	112,878	2038/12/ 7
UK GILT BOND	国債証券	1.25	1,100	1,029	195,955	2027/ 7/22
UK GILT BOND	国債証券	0.25	1,240	963	183,265	2031/ 7/31

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UK GILT BOND	国債証券	3.25	1,340	1,228	233,756	2033/ 1/31
UK GILT BOND	国債証券	0.875	1,200	896	170,640	2033/ 7/31
UK GILT BOND	国債証券	4.25	180	175	33,331	2034/ 7/31
UK GILT BOND	国債証券	1.75	950	682	129,806	2037/ 9/ 7
UK GILT BOND	国債証券	1.125	650	407	77,490	2039/ 1/31
UK GILT BOND	国債証券	4.75	180	172	32,845	2043/10/22
UK GILT BOND	国債証券	3.25	450	349	66,528	2044/ 1/22
UK GILT BOND	国債証券	4.375	310	272	51,772	2054/ 7/31
小計					4,351,452	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	2,530	2,487	35,079	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	3,200	3,070	43,290	2028/ 5/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.75	1,000	937	13,224	2029/11/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	180	171	2,421	2033/11/11
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	320	315	4,445	2035/ 5/11
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	2,680	2,977	41,979	2039/ 3/30
小計					140,440	
(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		
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5	450	439	5,967	2026/ 2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	2,410	2,318	31,504	2027/ 2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	600	568	7,727	2028/ 4/26
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,700	1,553	21,110	2029/ 9/ 6
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.375	1,550	1,361	18,504	2030/ 8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.125	1,170	1,039	14,122	2032/ 5/18
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	1,050	979	13,312	2033/ 8/15
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.625	670	653	8,881	2034/ 4/13
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	750	714	9,707	2042/10/ 6
小計					130,837	
(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		
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	250	251	5,313	2026/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	2,770	2,664	56,308	2027/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5	1,750	1,628	34,400	2029/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	20	17	365	2031/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	2,430	3,027	63,980	2039/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	1,960	1,091	23,073	2052/11/15
小計					183,442	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	3,350	3,226	121,712	2026/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	200	187	7,074	2027/ 7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.75	4,320	4,365	164,652	2029/ 4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	680	663	25,021	2030/ 1/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,080	1,653	62,357	2030/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	1,470	1,135	42,814	2032/ 4/25

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0	840	851	32,125	2033/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	410	385	14,524	2034/10/25
小計					470,283	
(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		
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	220	220	21,184	2026/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	1,010	1,027	98,585	2027/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	720	698	66,997	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.25	700	664	63,754	2028/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	370	359	34,501	2029/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5	200	185	17,754	2030/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,280	1,071	102,795	2030/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0	1,010	816	78,388	2031/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.25	2,000	1,618	155,312	2032/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	1,780	1,790	171,866	2033/ 4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	200	188	18,126	2034/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.25	150	147	14,132	2034/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	590	503	48,276	2035/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	350	296	28,471	2039/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	250	191	18,418	2041/ 5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	170	124	11,993	2047/ 3/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	350	182	17,545	2051/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.75	210	201	19,318	2054/ 6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.75	430	395	37,928	2037/ 4/21
小計					1,025,352	
(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		
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5	420	426	36,812	2027/ 4/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.25	800	713	61,497	2028/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	30	28	2,488	2029/ 4/20
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0	1,350	1,149	99,151	2032/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.75	370	235	20,304	2041/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	205	132	11,464	2051/ 5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0	70	67	5,831	2054/ 5/15
小計					237,550	
(シンガポール)			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5	700	710	80,016	2027/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	160	161	18,157	2029/ 4/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.875	525	526	59,284	2030/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.375	350	362	40,852	2033/ 9/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.375	190	197	22,238	2034/ 5/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.375	180	169	19,048	2039/ 7/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	195	190	21,514	2042/ 4/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	150	146	16,544	2046/ 3/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.875	160	131	14,834	2050/ 3/ 1

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.875	140	113	12,821	2051/10/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.25	50	54	6,085	2054/ 6/ 1
SINGAPORE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	90	92	10,444	2072/ 8/ 1
小計					321,844	
(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		
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.502	1,000	1,001	34,063	2027/ 5/31
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.582	300	296	10,085	2032/ 7/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.642	3,100	3,291	112,002	2033/11/ 7
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.757	200	194	6,631	2040/ 5/22
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.065	950	938	31,925	2050/ 6/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9	2,500	2,524	85,885	2026/11/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.498	1,500	1,558	53,014	2030/ 4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.935	730	812	27,629	2043/ 9/30
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.736	1,400	1,523	51,841	2046/ 3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.921	450	504	17,149	2048/ 7/ 6
小計					430,229	
(中国)			千人民元	千人民元		
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.99	16,000	16,103	334,276	2026/ 3/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3	27,800	28,120	583,733	2026/ 5/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.69	39,100	39,879	827,820	2026/ 8/12
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.37	21,000	21,390	444,023	2027/ 1/20
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.48	15,000	15,332	318,267	2027/ 4/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.62	5,000	5,024	104,306	2027/ 8/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.64	16,000	16,554	343,635	2028/ 1/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.91	23,000	24,161	501,554	2028/10/14
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.55	22,900	23,733	492,659	2028/10/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.37	23,500	24,252	503,428	2029/ 1/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.75	17,900	18,809	390,449	2029/ 6/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.91	26,500	26,945	559,335	2029/ 7/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.62	6,000	6,311	131,010	2030/ 6/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.54	15,000	15,749	326,940	2030/12/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.02	18,300	19,849	412,035	2031/ 5/27
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.12	13,500	13,889	288,329	2031/ 6/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	1.87	5,400	5,482	113,810	2031/ 9/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.89	27,800	30,011	622,988	2031/11/18
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.88	9,500	10,356	214,989	2033/ 2/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.67	9,000	9,667	200,685	2033/ 5/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.52	8,500	9,040	187,661	2033/ 8/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.35	12,000	12,634	262,270	2034/ 2/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	2.11	18,700	19,394	402,588	2034/ 8/25
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.86	13,000	17,858	370,710	2049/ 7/22
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.53	12,400	16,425	340,965	2051/10/18
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.32	13,800	17,737	368,188	2052/ 4/15
CHINESE GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0	1,700	2,099	43,585	2053/10/15
小計					9,690,252	

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	国債証券		2,000	1,950	83,128	2027/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	－	1,500	1,420	60,529	2028/ 9/28
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	－	940	814	34,719	2030/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	－	800	898	38,306	2042/ 1/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	－	1,345	1,235	52,672	2047/ 3/31
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	－	570	474	20,233	2032/ 4/30
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	－	160	160	6,853	2027/ 9/30
ISRAEL FIXED BOND	国債証券	－	250	259	11,056	2029/ 8/31
小計					307,499	
合計					84,627,332	

(注1) 外貨建金額は、原則として金融商品取引業者、価格情報会社等より入手した時価により評価したものです。また、邦貨換算金額は、当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) 金額の単位未満は切り捨てています。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('25年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 84,627,332	% 98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,027,788	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	85,655,120	100.0

(注1) 外貨建資産は、当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、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル＝151.13円、1カナダドル＝106.22円、1メキシコペソ＝7.391円、1ユーロ＝157.60円、1英ポンド＝190.30円、1スウェーデンクローナ＝14.10円、1ノルウェークローネ＝13.59円、1デンマーククローネ＝21.13円、1ポーランドズロチ＝37.717円、1オーストラリアドル＝95.97円、1ニュージーランドドル＝86.22円、1シンガポールドル＝112.64円、1マレーシアリンギット＝34.0229円、1人民元＝20.7582円、1イスラエルシェケル＝42.6259円、1オフショア人民元＝20.7557円です。

(注2) 当期末における外貨建純資産(85,637,892千円)の投資信託財産総額(85,655,120千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

( '25年2月20日現在 )

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	85,678,105,673
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	346,873,889
公 社 債 (評価額)	84,627,332,672
未 収 入 金	23,084,200
未 収 利 息	633,812,922
前 払 費 用	47,001,990
(B) 負 債	43,719,118
未 払 金	30,087,633
未 払 解 約 金	13,631,485
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	85,634,386,555
元 本	28,704,560,795
次 期 繰 越 損 益 金	56,929,825,760
(D) 受 益 権 総 口 数	28,704,560,795口
1万口当たり基準価額 (C/D×10,000)	29,833円

- (注1) 期首元本額 32,087,499,983円  
 期中追加設定元本額 4,703,861,796円  
 期中一部解約元本額 8,086,800,984円  
 (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。

ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン バランスファンドVA50B <適格機関投資家限定>	6,274,107,523円
4資産バランス40VA <適格機関投資家限定>	4,813,619,474円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン (為替ヘッジあり)	2,429,196,220円
世界分散タムスフレッド・プレミアム戦略ファンド/為替ヘッジ付<適格機関投資家限定>	2,177,406,453円
バランスファンドVA35A <適格機関投資家限定>	1,499,001,652円
外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き (年金) <適格機関投資家限定>	1,454,582,343円
バランスファンドVA25A <適格機関投資家限定>	1,412,131,120円
世界分散ファンドVA25A <適格機関投資家限定>	1,052,443,546円
AMC/ステート・ストリート・リスク(ジェット型)ランス・オープン (ステイブル)	896,046,559円
バランスファンドVA37.5A <適格機関投資家限定>	867,750,986円
グローバル(ランス40VA2 <適格機関投資家限定>	804,372,828円
4資産インデックス(ランスVA20 <適格機関投資家限定>	603,659,197円
外国債券インデックス・ファンドVA3 <適格機関投資家限定>	593,682,305円
外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	530,821,556円
4資産バランス30VA <適格機関投資家限定>	400,186,300円
フレックス資産配分戦略ファンド<適格機関投資家限定>	389,251,122円
バランスファンドVA25B <適格機関投資家限定>	376,515,782円
4資産バランス20VA <適格機関投資家限定>	345,886,044円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド (年金) <適格機関投資家限定>	338,322,539円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン	286,731,255円
Ta dリスク(ジェット型)マルチ配分戦略ファンド (ステイブル) 年金<適格機関投資家限定>	207,304,041円
Ta dリスク(ジェット型)マルチ配分戦略ファンド (ステイブル) <適格機関投資家限定>	182,418,457円
	179,819,666円

◎損益の状況

当期 (自 '24年2月21日 至 '25年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	2,335,262,859
受 取 利 息	2,335,202,613
そ の 他 収 益 金	64,701
支 払 利 息	△ 4,455
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	560,711,992
売 買 益	2,591,406,965
売 買 損	△ 2,030,694,973
(C) そ の 他 費 用	△ 42,553,355
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	2,853,421,496
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	61,141,095,130
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,452,337,744
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 16,517,028,610
(H) 計 (D+E+F+G)	56,929,825,760
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	56,929,825,760

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。  
 (注2) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。  
 (注3) (G)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

外国債券インデックス・ファンドA/為替ヘッジ付き<適格機関投資家限定>	164,446,229円
グローバール4資産30VA <適格機関投資家限定>	56,274,450円
外国債券インデックス・ファンドVA1 <適格機関投資家限定>	53,284,689円
バランスファンドVA40C <適格機関投資家限定>	53,146,648円
4資産インデックス(ランスVA50 <適格機関投資家限定>	45,688,841円
グローバール4資産45VA <適格機関投資家限定>	44,337,599円
バランスファンドVA30B <適格機関投資家限定>	40,536,967円
ステート・ストリートDCグローバール債券インデックス・オープン	31,298,065円
グローバール(ランス40VA3 <適格機関投資家限定>	24,996,942円
4資産バランス30VA2 <適格機関投資家限定>	20,127,578円
バランスファンドVA75A <適格機関投資家限定>	19,133,965円
ステート・ストリート・グローバール債券インデックス・オープン (陽明大型)	9,696,520円
グローバール(ランス50VA <適格機関投資家限定>	8,580,207円
世界バランス60VA <適格機関投資家限定>	6,344,125円
世界バランス40VA <適格機関投資家限定>	3,921,897円
バランスファンドVA40B <適格機関投資家限定>	1,912,039円
バランスファンドVA50A <適格機関投資家限定>	1,426,151円
バランスファンドVA30A <適格機関投資家限定>	1,337,953円
バランスファンドVA20A <適格機関投資家限定>	980,231円
バランスファンドVA50C <適格機関投資家限定>	850,933円
グローバール(ランス40VA <適格機関投資家限定>	593,350円
バランスファンドVA35B <適格機関投資家限定>	310,462円
バランスファンドVA40A <適格機関投資家限定>	77,986円