

インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型 〈愛称 DC インデックス海外債券（ヘッジなし）〉

運用報告書（全体版）

第21期（決算日 2022年10月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。

「インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型」は、2022年10月26日に第21期の決算を行ないましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

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	2001年10月17日から原則無期限です。	
運用方針	主として「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券に投資を行ない、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要運用対象	インデックスファンド 海外債券（ヘッジなし）1年決算型	「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	海外債券インデックス（ヘッジなし） マザーファンド	内外の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	インデックスファンド 海外債券（ヘッジなし）1年決算型	株式への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	海外債券インデックス（ヘッジなし） マザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。 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。	

<958441>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 率		
	円	円	%		%	%	百万円
17期(2018年10月26日)	18,573	10	△4.3	214.77	△3.5	98.9	9,235
18期(2019年10月28日)	19,454	10	4.8	226.62	5.5	99.1	9,685
19期(2020年10月26日)	20,188	10	3.8	236.60	4.4	99.2	9,568
20期(2021年10月26日)	21,081	10	4.5	249.33	5.4	99.3	9,581
21期(2022年10月26日)	21,430	10	1.7	255.49	2.5	99.1	9,543

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、設定時を100として2022年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期 首) 2021年10月26日	円	%		%	%
	21,081	—	249.33	—	99.3
10月末	21,219	0.7	250.75	0.6	99.1
11月末	20,970	△0.5	247.74	△0.6	99.4
12月末	21,087	0.0	249.54	0.1	99.2
2022年1月末	20,713	△1.7	245.44	△1.6	99.3
2月末	20,327	△3.6	241.40	△3.2	98.6
3月末	20,989	△0.4	248.81	△0.2	99.2
4月末	21,024	△0.3	249.16	△0.1	99.2
5月末	20,879	△1.0	248.19	△0.5	99.2
6月末	21,369	1.4	254.19	1.9	99.2
7月末	21,503	2.0	255.22	2.4	99.2
8月末	21,233	0.7	251.98	1.1	99.2
9月末	21,033	△0.2	249.39	0.0	99.2
(期 末) 2022年10月26日	円	%		%	%
	21,440	1.7	255.49	2.5	99.1

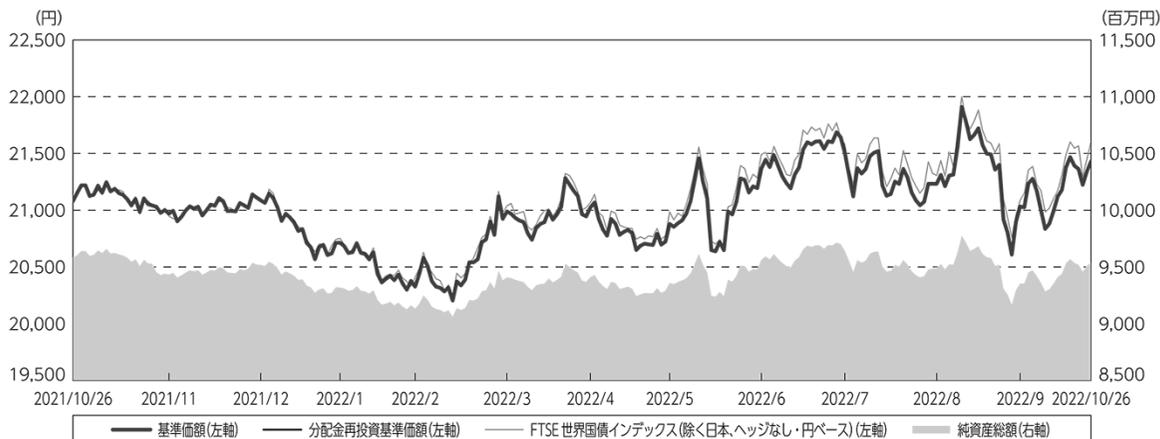
(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

○運用経過

(2021年10月27日～2022年10月26日)

期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、期首（2021年10月26日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は当ファンドのベンチマークです。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主に、「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・ 欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大や、南アフリカで確認された新たな変異株の感染拡大が警戒されたこと。
- ・ 米国やユーロ圏の市場予想を下回る景況感に関する指標などを背景に、景気後退の可能性が懸念されたこと。
- ・ 円安/アメリカドル高、円安/ユーロ高、円安/イギリスポンド高となったこと。

＜値下がり要因＞

- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）や欧州中央銀行（ECB）など主要国の中央銀行が政策金利を引き上げたこと。
- ・米国の消費者物価指数（CPI）が市場予想を上回り、FRBによる金融引き締め長期化観測が強まったこと。
- ・原油や天然ガスなどのエネルギー価格の上昇を受けて、インフレの高進が懸念されたこと（期間の初め～2022年6月前半）。

投資環境

（海外債券市況）

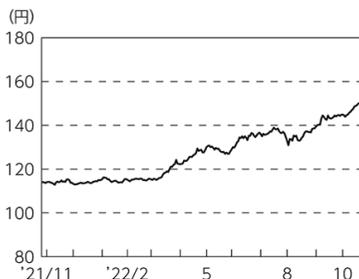
海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など、各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて上昇（債券価格は下落）しました。

期間の初めから2022年6月前半にかけては、欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大や南アフリカで確認された新たな変異株の感染拡大に対する警戒感、ロシアによる軍事侵攻などウクライナ情勢の緊迫化などが利回りの低下（債券価格は上昇）要因となったものの、FRBやカナダの中央銀行など主要中央銀行が政策金利を引き上げたことや、ECBが政策金利の引き上げ開始や大幅な利上げの可能性を示唆したこと、原油や天然ガスなどのエネルギー価格の上昇を受けてインフレの高進が懸念されたことなどを背景に、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。6月後半から7月下旬にかけては、FRBやECBによる政策金利の引き上げなどが利回りの上昇要因となったものの、米国や欧州の中央銀行による金融引き締め加速や米国やユーロ圏の市場予想を下回る景況感に関する指標などを背景に景気後退の可能性が懸念されたことなどをを受けて、投資対象国の10年国債利回りは総じて低下しました。8月上旬から期間末にかけては、ECBやオーストラリア準備銀行（RBA）など主要中央銀行が政策金利を引き上げたことや、タカ派（金融引き締めの政策を支持）的とみなされた複数のFRB高官の発言や、市場予想を上回る米国のCPIを受けてFRBによる金融引き締め長期化観測が強まったことなどを背景に、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。

円／アメリカドルの推移



円／ユーロの推移



当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券を高位に組み入れて運用を行ないました。

（海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド）

債券のリスクコントロールモデルによりベンチマークが採用している国の債券の中からポートフォリオを構築し、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、債券の組入比率を高位に維持してベンチマークとの連動性を保つように努めました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、1.7%（分配金再投資ベース）の値上がりとなり、ベンチマークである「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」の上昇率2.5%を概ね0.8%下回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

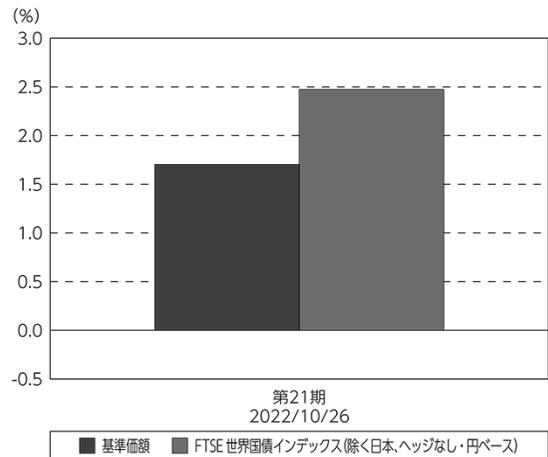
＜プラス要因＞

- ・投資銘柄の選択による効果が寄与したこと。
- ・投資国の選択による効果が寄与したこと。

＜マイナス要因＞

- ・投資通貨の選択が影響したこと。
- ・外国口座の管理費用を支払ったこと。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

（注）FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は当ファンドのベンチマークです。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、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

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第21期
	2021年10月27日～ 2022年10月26日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.047%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	12,180

（注）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）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。

○今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、ファンドの基本方針に則り、「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券を原則として高位に組み入れて運用を行いません。

（海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド）

引き続き、これまでの運用方針を維持します。原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度などの属性をベンチマークと同程度に保ち、連動性を高めるように努めます。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行なうとともに、債券組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 155	% 0.737	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(51)	(0.242)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(93)	(0.440)	運用報告書など各種書類の送付、口内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	(12)	(0.055)	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	4	0.021	(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 ）	(3)	(0.016)	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)	(0.004)	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
合 計	159	0.758	
期中の平均基準価額は、21,028円です。			

(注) 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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

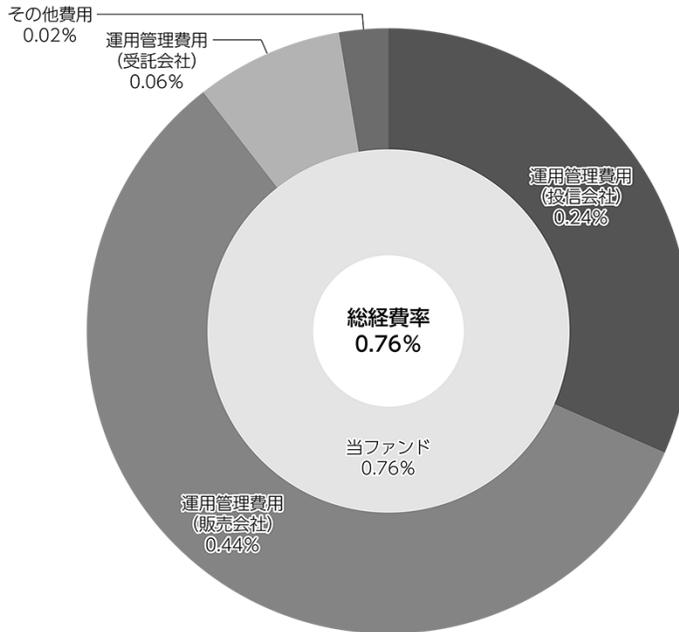
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

（参考情報）

○総経費率

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、売買委託手数料およ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0.76%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 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。

○売買及び取引の状況

(2021年10月27日～2022年10月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	千口 116,510	千円 301,030	千口 219,736	千円 565,682

○利害関係人との取引状況等

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年10月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	3,711,173	3,607,947	9,542,299

(注) 親投資信託の2022年10月26日現在の受益権総口数は、57,575,300千口です。

○投資信託財産の構成

(2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	9,542,299	99.5
コール・ローン等、その他	51,379	0.5
投資信託財産総額	9,593,678	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（152,311,600千円）の投資信託財産総額（152,381,198千円）に対する比率は100.0%です。

(注) 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。1アメリカドル=148.23円、1カナダドル=108.69円、1メキシコペソ=7.4535円、1ユーロ=147.36円、1イギリスポンド=169.52円、1スウェーデンクローナ=13.49円、1ノルウェークローネ=14.20円、1デンマーククローネ=19.81円、1ポーランドズロチ=30.9265円、1オーストラリアドル=94.51円、1シンガポールドル=104.50円、1マレーシアリングgit=31.3271円、1中国人民元=20.3869円、1イスラエルシケル=42.0932円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年10月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,593,678,716
コール・ローン等	40,179,030
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド（評価額）	9,542,299,592
未収入金	11,200,094
(B) 負債	50,429,261
未払収益分配金	4,453,268
未払解約金	10,760,960
未払信託報酬	35,006,034
未払利息	65
その他未払費用	208,934
(C) 純資産総額（A－B）	9,543,249,455
元本	4,453,268,961
次期繰越損益金	5,089,980,494
(D) 受益権総口数	4,453,268,961口
1万口当たり基準価額（C／D）	21,430円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,545,096,386円、期中追加設定元本額は373,271,803円、期中一部解約元本額は465,099,228円です。

(注) 1口当たり純資産額は2,1430円です。

○損益の状況（2021年10月27日～2022年10月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,768
支払利息	△ 3,768
(B) 有価証券売買損益	229,556,294
売買益	245,815,752
売買損	△ 16,259,458
(C) 信託報酬等	△ 69,911,693
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	159,640,833
(E) 前期繰越損益金	1,841,449,448
(F) 追加信託差損益金	3,093,343,481
（配当等相当額）	（ 3,218,784,731）
（売買損益相当額）	（△ 125,441,250）
(G) 計（D＋E＋F）	5,094,433,762
(H) 収益分配金	△ 4,453,268
次期繰越損益金（G＋H）	5,089,980,494
追加信託差損益金	3,093,343,481
（配当等相当額）	（ 3,219,232,333）
（売買損益相当額）	（△ 125,888,852）
分配準備積立金	2,205,006,407
繰越損益金	△ 208,369,394

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 分配金の計算過程（2021年10月27日～2022年10月26日）は以下の通りです。

項 目	2021年10月27日～ 2022年10月26日
a. 配当等収益（経費控除後）	127,317,514円
b. 有価証券売買等損益（経費控除後・繰越欠損金補填後）	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	3,219,232,333円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	2,082,142,161円
e. 分配対象収益（a＋b＋c＋d）	5,428,692,008円
f. 分配対象収益（1万口当たり）	12,190円
g. 分配金	4,453,268円
h. 分配金（1万口当たり）	10円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	10円
-----------------	-----

○お知らせ

約款変更について

2021年10月27日から2022年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第24期（決算日 2022年10月26日）
（2021年10月27日～2022年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1998年10月30日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として世界各国の債券に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率	純資産額
	期騰	期中率	期騰	期中率		
	円	%		%	%	百万円
20期(2018年10月26日)	22,220	△3.6	221.52	△3.5	98.9	147,033
21期(2019年10月28日)	23,455	5.6	233.74	5.5	99.1	154,835
22期(2020年10月26日)	24,530	4.6	244.04	4.4	99.2	152,834
23期(2021年10月26日)	25,816	5.2	257.16	5.4	99.3	159,216
24期(2022年10月26日)	26,448	2.4	263.52	2.5	99.2	152,274

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、設定時を100として2022年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率	券率
	騰	落率	騰	落率		
(期首) 2021年10月26日	円	%		%		%
	25,816	—	257.16	—	—	99.3
10月末	25,986	0.7	258.63	0.6	0.6	99.1
11月末	25,697	△0.5	255.53	△0.6	△0.6	99.4
12月末	25,857	0.2	257.38	0.1	0.1	99.2
2022年1月末	25,414	△1.6	253.15	△1.6	△1.6	99.3
2月末	24,955	△3.3	248.98	△3.2	△3.2	98.7
3月末	25,783	△0.1	256.63	△0.2	△0.2	99.2
4月末	25,841	0.1	256.99	△0.1	△0.1	99.2
5月末	25,680	△0.5	255.99	△0.5	△0.5	99.2
6月末	26,298	1.9	262.17	1.9	1.9	99.2
7月末	26,479	2.6	263.24	2.4	2.4	99.2
8月末	26,164	1.3	259.90	1.1	1.1	99.2
9月末	25,932	0.4	257.23	0.0	0.0	99.2
(期末) 2022年10月26日	円	%		%		%
	26,448	2.4	263.52	2.5	2.5	99.2

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2021年10月27日～2022年10月26日）

基準価額の推移

期間の初め25,816円の基準価額は、期間末に26,448円となり、騰落率は+2.4%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

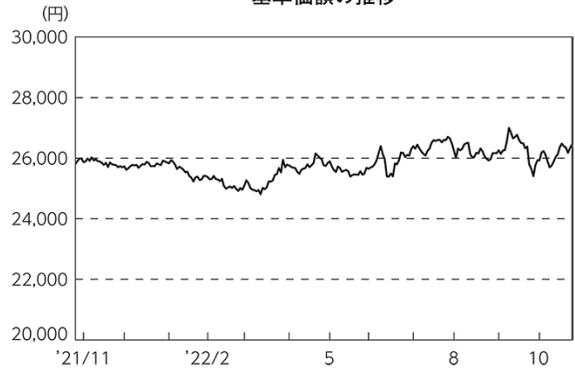
<値上がり要因>

- ・欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大や、南アフリカで確認された新たな変異株の感染拡大が警戒されたこと。
- ・米国やユーロ圏の市場予想を下回る景況感に関する指標などを背景に、景気後退の可能性が懸念されたこと。
- ・円安／アメリカドル高、円安／ユーロ高、円安／イギリスポンド高となったこと。

<値下がり要因>

- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）や欧州中央銀行（ECB）など主要国の中央銀行が政策金利を引き上げたこと。
- ・米国の消費者物価指数（CPI）が市場予想を上回り、FRBによる金融引き締め長期化観測が強まったこと。
- ・原油や天然ガスなどのエネルギー価格の上昇を受けて、インフレの高進が懸念されたこと（期間の初め～2022年6月前半）。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2021/10/26	2022/09/08	2022/03/11	2022/10/26
25,816円	27,001円	24,809円	26,448円

FTSE世界国債インデックス
（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（指数化）の推移

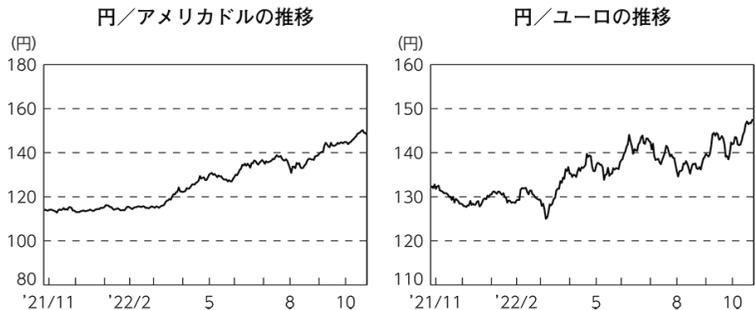
（海外債券市況）

海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など、各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて上昇（債券価格は下落）しました。

期間の初めから2022年6月前半にかけては、欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大や南アフリカで確認された新たな変異株の感染拡大に対する警戒感、ロシアによる軍事侵攻などウクライナ情勢の緊迫化などが利回りの低下（債券価格は上昇）要因となったものの、FRBやカナダの中央銀行など主要中央銀行が政策金利を引き上げたことや、ECBが政策金利の引き上げ開始や大幅な利上げの可能性を示唆したこと、原油や天然ガスなどのエネルギー価格の上昇を受けてインフレの高進が懸念されたことなどを背景に、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。6月後半から7月下旬にかけては、FRBやECBによる政策金利の引き上げなどが利回りの上昇要因となったものの、米国や欧州の中央銀行による金融引き締め加速や米国やユーロ圏の市場予想を下回る景況感に関する指標などを背景に景気後退の可能性が懸念されたことなどをを受けて、投資対象国の10年国債利回りは総じて低下しました。8月上旬から期間末にかけては、ECBやオーストラリア準備銀行（RBA）など主要中央銀行が政策金利を引き上げたことや、タカ派（金融引き締めの政策を支持）的とみなされた複数のFRB高官の発言や、市場予想を上回る米国のCPIを受けてFRBによる金融引き締めの長期化観測が強まったことなどを背景に、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。



ポートフォリオ

債券のリスクコントロールモデルによりベンチマークが採用している国の債券の中からポートフォリオを構築し、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、債券の組入比率を高位に維持してベンチマークとの連動性を保つように努めました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、2.4%の値上がりとなり、ベンチマークである「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」の上昇率2.5%と概ね同水準となりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・投資銘柄の選択による効果が寄与したこと。
- ・投資国の選択による効果が寄与したこと。

<マイナス要因>

- ・投資通貨の選択が影響したこと。
- ・外国口座の管理費用を支払ったこと。

○今後の運用方針

引き続き、これまでの運用方針を維持します。原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度などの属性をベンチマークと同程度に保ち、連動性を高めるように努めます。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行なうとともに、債券組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○1万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	円 4 (4)	% 0.016 (0.016)	(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
合 計	4	0.016	
期中の平均基準価額は、25,840円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○利害関係人との取引状況等

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2021年10月27日～2022年10月26日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2022年10月26日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末								
	額面金額	評 価 額		組入比率	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	千アメリカドル 604,930	千アメリカドル 526,775	千円 78,083,916	% 51.3	% —	% 22.0	% 18.3	% 11.0	
カナダ	千カナダドル 31,629	千カナダドル 28,322	3,078,358	2.0	—	1.0	0.6	0.5	
メキシコ	千メキシコペソ 186,410	千メキシコペソ 168,383	1,255,043	0.8	—	0.4	0.3	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
ドイツ	67,990	65,229	9,612,257	6.3	—	3.6	1.6	1.1	
イタリア	84,609	78,381	11,550,345	7.6	—	4.2	2.3	1.1	
フランス	94,514	89,124	13,133,319	8.6	—	5.3	2.5	0.8	
オランダ	17,059	15,938	2,348,760	1.5	—	1.0	0.4	0.2	
スペイン	55,048	52,288	7,705,219	5.1	—	3.0	1.5	0.5	
ベルギー	20,988	19,676	2,899,471	1.9	—	1.3	0.4	0.2	
オーストリア	13,888	12,528	1,846,243	1.2	—	0.6	0.4	0.2	
フィンランド	6,007	5,174	762,453	0.5	—	0.3	0.2	0.0	
アイルランド	7,443	6,647	979,637	0.6	—	0.4	0.2	0.0	
イギリス	千イギリスポンド 44,120	千イギリスポンド 39,111	6,630,252	4.4	—	3.3	0.7	0.3	
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 29,735	千スウェーデンクローナ 28,947	390,499	0.3	—	0.1	0.1	0.1	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 23,840	千ノルウェークローネ 21,793	309,464	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーククローネ 26,860	千デンマーククローネ 27,436	543,525	0.4	—	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランドズロチ 25,905	千ポーランドズロチ 20,749	641,714	0.4	—	0.1	0.2	0.1	
オーストラリア	千オーストラリアドル 27,115	千オーストラリアドル 23,957	2,264,192	1.5	—	1.0	0.4	0.0	
シンガポール	千シンガポールドル 7,059	千シンガポールドル 6,626	692,485	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
マレーシア	千マレーシアリンギット 25,825	千マレーシアリンギット 24,852	778,544	0.5	—	0.3	0.1	0.0	
中国	千中国人民元 235,000	千中国人民元 240,422	4,901,467	3.2	—	1.4	1.1	0.7	
イスラエル	千イスラエルシェケル 14,025	千イスラエルシェケル 13,640	574,169	0.4	—	0.2	0.2	0.1	
合 計	—	—	150,981,343	99.2	—	50.4	31.5	17.2	

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価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。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
(アメリカ)					
国債証券					
US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,429	360,051	2023/9/30
US TREASURY N/B	2.875	660	650	96,471	2023/9/30
US TREASURY N/B	0.25	3,500	3,363	498,521	2023/9/30
US TREASURY N/B	0.125	1,400	1,341	198,873	2023/10/15
US TREASURY N/B	1.625	1,700	1,651	244,827	2023/10/31
US TREASURY N/B	2.875	900	885	131,245	2023/10/31
US TREASURY N/B	2.75	4,000	3,926	582,040	2023/11/15
US TREASURY N/B	0.25	7,000	6,692	991,981	2023/11/15
US TREASURY N/B	2.125	2,680	2,611	387,030	2023/11/30
US TREASURY N/B	2.875	1,810	1,778	263,637	2023/11/30
US TREASURY N/B	0.5	4,000	3,828	567,466	2023/11/30
US TREASURY N/B	0.125	3,000	2,854	423,185	2023/12/15
US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,947	288,689	2023/12/31
US TREASURY N/B	2.625	2,470	2,415	358,040	2023/12/31
US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,942	288,006	2024/1/31
US TREASURY N/B	2.5	2,520	2,455	363,989	2024/1/31
US TREASURY N/B	2.75	3,300	3,222	477,675	2024/2/15
US TREASURY N/B	0.125	5,000	4,719	699,634	2024/2/15
US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,452	215,275	2024/2/29
US TREASURY N/B	2.375	1,630	1,583	234,743	2024/2/29
US TREASURY N/B	0.25	5,000	4,710	698,244	2024/3/15
US TREASURY N/B	2.125	3,860	3,729	552,834	2024/3/31
US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,923	285,169	2024/4/30
US TREASURY N/B	2.25	3,000	2,897	429,455	2024/4/30
US TREASURY N/B	2.5	3,380	3,273	485,164	2024/5/15
US TREASURY N/B	0.25	2,830	2,646	392,338	2024/5/15
US TREASURY N/B	2.0	3,870	3,716	550,928	2024/5/31
US TREASURY N/B	0.25	4,700	4,381	649,437	2024/6/15
US TREASURY N/B	2.0	2,300	2,204	326,825	2024/6/30
US TREASURY N/B	1.75	2,660	2,539	376,471	2024/6/30
US TREASURY N/B	2.125	2,490	2,387	353,882	2024/7/31
US TREASURY N/B	1.75	4,640	4,420	655,251	2024/7/31
US TREASURY N/B	2.375	4,620	4,445	658,927	2024/8/15
US TREASURY N/B	0.375	5,000	4,640	687,908	2024/8/15
US TREASURY N/B	1.875	1,420	1,353	200,603	2024/8/31
US TREASURY N/B	1.25	2,300	2,167	321,232	2024/8/31
US TREASURY N/B	0.375	6,000	5,554	823,301	2024/9/15
US TREASURY N/B	2.125	2,015	1,927	285,744	2024/9/30
US TREASURY N/B	1.5	2,200	2,079	308,310	2024/9/30
US TREASURY N/B	2.25	1,090	1,043	154,703	2024/10/31
US TREASURY N/B	1.5	2,140	2,018	299,133	2024/10/31
US TREASURY N/B	2.25	4,650	4,448	659,356	2024/11/15
US TREASURY N/B	2.125	1,400	1,334	197,794	2024/11/30
US TREASURY N/B	1.5	3,470	3,264	483,878	2024/11/30
US TREASURY N/B	1.0	1,800	1,674	248,168	2024/12/15
US TREASURY N/B	2.25	1,900	1,812	268,721	2024/12/31
US TREASURY N/B	1.75	1,300	1,228	182,059	2024/12/31
US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,436	212,904	2025/1/31
US TREASURY N/B	1.375	3,510	3,279	486,153	2025/1/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
(アメリカ)					
国債証券					
US TREASURY N/B	2.0	4,530	4,285	635,206	2025/2/15
US TREASURY N/B	2.75	2,060	1,981	293,759	2025/2/28
US TREASURY N/B	1.125	1,540	1,426	211,438	2025/2/28
US TREASURY N/B	2.625	2,010	1,926	285,593	2025/3/31
US TREASURY N/B	0.5	3,470	3,160	468,467	2025/3/31
US TREASURY N/B	2.625	2,600	2,488	368,822	2025/4/15
US TREASURY N/B	2.875	2,200	2,116	313,749	2025/4/30
US TREASURY N/B	0.375	2,150	1,943	288,069	2025/4/30
US TREASURY N/B	2.125	3,800	3,585	531,501	2025/5/15
US TREASURY N/B	2.875	1,420	1,364	202,264	2025/5/31
US TREASURY N/B	0.25	3,820	3,428	508,165	2025/5/31
US TREASURY N/B	2.875	5,000	4,803	712,083	2025/6/15
US TREASURY N/B	2.75	1,370	1,311	194,468	2025/6/30
US TREASURY N/B	3.0	5,000	4,813	713,458	2025/7/15
US TREASURY N/B	2.875	1,440	1,381	204,738	2025/7/31
US TREASURY N/B	0.25	3,000	2,674	396,468	2025/7/31
US TREASURY N/B	2.0	4,730	4,423	655,746	2025/8/15
US TREASURY N/B	2.75	3,000	2,862	424,331	2025/8/31
US TREASURY N/B	3.0	4,200	4,033	597,882	2025/9/30
US TREASURY N/B	0.25	320	283	42,038	2025/9/30
US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,342	199,042	2025/10/31
US TREASURY N/B	0.25	1,800	1,588	235,463	2025/10/31
US TREASURY N/B	2.25	3,440	3,223	477,882	2025/11/15
US TREASURY N/B	2.875	1,320	1,259	186,721	2025/11/30
US TREASURY N/B	0.375	3,420	3,020	447,677	2025/11/30
US TREASURY N/B	2.625	2,000	1,892	280,571	2025/12/31
US TREASURY N/B	2.625	1,850	1,748	259,175	2026/1/31
US TREASURY N/B	0.375	3,000	2,632	390,145	2026/1/31
US TREASURY N/B	6.0	1,800	1,885	279,414	2026/2/15
US TREASURY N/B	1.625	3,310	3,025	448,438	2026/2/15
US TREASURY N/B	2.5	1,790	1,682	249,442	2026/2/28
US TREASURY N/B	0.5	3,650	3,205	475,205	2026/2/28
US TREASURY N/B	2.25	2,070	1,928	285,896	2026/3/31
US TREASURY N/B	0.75	2,400	2,121	314,347	2026/3/31
US TREASURY N/B	2.375	320	299	44,341	2026/4/30
US TREASURY N/B	0.75	2,740	2,415	357,999	2026/4/30
US TREASURY N/B	1.625	4,840	4,400	652,331	2026/5/15
US TREASURY N/B	2.125	2,740	2,534	375,657	2026/5/31
US TREASURY N/B	0.75	2,800	2,461	364,882	2026/5/31
US TREASURY N/B	1.875	2,000	1,830	271,376	2026/6/30
US TREASURY N/B	1.875	960	877	130,049	2026/7/31
US TREASURY N/B	0.625	3,260	2,837	420,598	2026/7/31
US TREASURY N/B	1.5	4,000	3,597	533,211	2026/8/15
US TREASURY N/B	0.75	3,000	2,617	387,957	2026/8/31
US TREASURY N/B	1.625	1,620	1,461	216,686	2026/9/30
US TREASURY N/B	0.875	3,000	2,624	389,025	2026/9/30
US TREASURY N/B	1.625	2,450	2,205	326,861	2026/10/31
US TREASURY N/B	1.125	4,950	4,364	646,879	2026/10/31
US TREASURY N/B	2.0	3,040	2,774	411,251	2026/11/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 権 金 額	
(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 TREASURY N/B	1.625	2,870	2,580	382,462	2026/11/30
US TREASURY N/B	1.25	2,210	1,955	289,838	2026/11/30
US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,804	267,474	2026/12/31
US TREASURY N/B	1.5	4,000	3,562	528,115	2027/1/31
US TREASURY N/B	2.25	2,060	1,892	280,484	2027/2/15
US TREASURY N/B	1.125	1,530	1,388	198,451	2027/2/28
US TREASURY N/B	0.625	3,310	2,822	418,367	2027/3/31
US TREASURY N/B	0.5	2,450	2,071	307,057	2027/4/30
US TREASURY N/B	2.375	3,530	3,248	481,473	2027/5/15
US TREASURY N/B	0.5	1,600	1,348	199,943	2027/5/31
US TREASURY N/B	0.5	3,100	2,607	386,439	2027/6/30
US TREASURY N/B	3.25	5,000	4,782	708,869	2027/6/30
US TREASURY N/B	0.375	7,000	5,838	865,431	2027/7/31
US TREASURY N/B	2.75	930	868	128,807	2027/7/31
US TREASURY N/B	2.25	2,960	2,700	400,240	2027/8/15
US TREASURY N/B	0.5	2,100	1,756	260,383	2027/8/31
US TREASURY N/B	0.375	4,090	3,387	502,154	2027/9/30
US TREASURY N/B	0.5	3,860	3,208	475,525	2027/10/31
US TREASURY N/B	6.125	1,400	1,513	224,391	2027/11/15
US TREASURY N/B	2.25	3,020	2,743	406,666	2027/11/15
US TREASURY N/B	0.625	220	183	27,215	2027/11/30
US TREASURY N/B	0.625	3,960	3,295	488,486	2027/12/31
US TREASURY N/B	0.75	2,850	2,379	352,717	2028/1/31
US TREASURY N/B	2.75	4,000	3,710	549,979	2028/2/15
US TREASURY N/B	1.125	3,830	3,257	482,873	2028/2/29
US TREASURY N/B	1.25	960	820	121,556	2028/3/31
US TREASURY N/B	1.25	3,370	2,872	425,717	2028/4/30
US TREASURY N/B	2.875	2,440	2,270	336,547	2028/5/15
US TREASURY N/B	1.25	4,300	3,657	542,154	2028/5/31
US TREASURY N/B	1.25	3,300	2,801	415,211	2028/6/30
US TREASURY N/B	1.0	2,920	2,435	361,025	2028/7/31
US TREASURY N/B	2.875	4,200	3,899	578,062	2028/8/15
US TREASURY N/B	1.125	3,900	3,269	484,698	2028/8/31
US TREASURY N/B	1.25	4,000	3,372	499,859	2028/9/30
US TREASURY N/B	1.375	4,000	3,391	502,684	2028/10/31
US TREASURY N/B	5.25	1,070	1,124	166,647	2028/11/15
US TREASURY N/B	3.125	4,510	4,236	627,962	2028/11/15
US TREASURY N/B	1.5	6,000	5,118	758,648	2028/11/30
US TREASURY N/B	1.375	870	736	109,142	2028/12/31
US TREASURY N/B	2.625	4,370	3,977	589,567	2029/2/15
US TREASURY N/B	2.375	4,630	4,145	614,443	2029/3/31
US TREASURY N/B	2.375	4,180	3,737	553,962	2029/5/15
US TREASURY N/B	3.25	2,650	2,500	370,621	2029/6/30
US TREASURY N/B	1.625	3,470	2,954	437,887	2029/8/15
US TREASURY N/B	1.75	1,390	1,191	176,670	2029/11/15
US TREASURY N/B	1.5	4,340	3,627	537,673	2030/2/15
US TREASURY N/B	6.25	1,060	1,200	177,939	2030/5/15
US TREASURY N/B	0.625	4,590	3,558	527,477	2030/5/15
US TREASURY N/B	0.625	5,090	3,918	580,898	2030/8/15
US TREASURY N/B	0.875	6,110	4,788	709,830	2030/11/15
US TREASURY N/B	5.375	560	607	90,092	2031/2/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 権 金 額	
(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 TREASURY N/B	1.125	4,400	3,506	519,756	2031/2/15
US TREASURY N/B	1.625	7,480	6,159	912,951	2031/5/15
US TREASURY N/B	1.25	7,600	6,012	891,205	2031/8/15
US TREASURY N/B	1.375	6,830	5,426	804,431	2031/11/15
US TREASURY N/B	1.875	6,500	5,382	797,894	2032/2/15
US TREASURY N/B	2.875	4,600	4,152	615,589	2032/5/15
US TREASURY N/B	2.75	3,200	2,852	422,751	2032/8/15
US TREASURY N/B	4.5	800	828	122,880	2036/2/15
US TREASURY N/B	5.0	750	811	120,313	2037/5/15
US TREASURY N/B	4.375	670	677	100,489	2038/2/15
US TREASURY N/B	4.5	720	737	109,389	2038/5/15
US TREASURY N/B	3.5	800	722	107,154	2039/2/15
US TREASURY N/B	4.25	1,450	1,436	212,868	2039/5/15
US TREASURY N/B	4.5	1,420	1,449	214,840	2039/8/15
US TREASURY N/B	4.375	750	751	111,465	2039/11/15
US TREASURY N/B	4.625	680	702	104,160	2040/2/15
US TREASURY N/B	4.375	1,590	1,589	235,671	2040/5/15
US TREASURY N/B	1.125	3,700	2,187	324,228	2040/5/15
US TREASURY N/B	3.875	1,440	1,344	199,293	2040/8/15
US TREASURY N/B	1.125	3,000	1,759	260,786	2040/8/15
US TREASURY N/B	4.25	1,010	990	146,767	2040/11/15
US TREASURY N/B	1.375	3,100	1,897	281,200	2040/11/15
US TREASURY N/B	4.75	1,500	1,569	232,619	2041/2/15
US TREASURY N/B	1.875	4,200	2,814	417,180	2041/2/15
US TREASURY N/B	4.375	870	865	128,287	2041/5/15
US TREASURY N/B	2.25	4,900	3,505	519,564	2041/5/15
US TREASURY N/B	3.75	960	873	129,477	2041/8/15
US TREASURY N/B	1.75	3,190	2,064	306,025	2041/8/15
US TREASURY N/B	2.0	3,000	2,029	300,808	2041/11/15
US TREASURY N/B	3.125	500	411	61,055	2042/2/15
US TREASURY N/B	2.75	800	613	90,874	2042/8/15
US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,528	226,502	2042/11/15
US TREASURY N/B	3.125	1,765	1,433	212,499	2043/2/15
US TREASURY N/B	2.875	2,050	1,591	235,927	2043/5/15
US TREASURY N/B	3.625	1,950	1,715	254,249	2043/8/15
US TREASURY N/B	3.75	2,090	1,870	277,259	2043/11/15
US TREASURY N/B	3.625	1,080	945	140,089	2044/2/15
US TREASURY N/B	3.375	2,200	1,843	273,292	2044/5/15
US TREASURY N/B	3.125	2,150	1,724	255,640	2044/8/15
US TREASURY N/B	3.0	2,300	1,801	267,109	2044/11/15
US TREASURY N/B	2.5	2,820	2,009	297,929	2045/2/15
US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,093	162,158	2045/5/15
US TREASURY N/B	2.875	1,390	1,060	157,185	2045/8/15
US TREASURY N/B	3.0	1,190	928	137,607	2045/11/15
US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,061	157,361	2046/2/15
US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,059	156,983	2046/5/15
US TREASURY N/B	2.25	2,150	1,438	213,201	2046/8/15
US TREASURY N/B	2.875	1,540	1,171	173,680	2046/11/15
US TREASURY N/B	3.0	2,000	1,556	230,769	2047/2/15
US TREASURY N/B	3.0	1,780	1,385	205,441	2047/5/15
US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,483	219,971	2047/8/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 権 金 額	
	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
(アメリカ) 国債証券					
US TREASURY N/B	2.75	1,740	1,291	191,475	2047/11/15
US TREASURY N/B	3.0	2,750	2,148	318,415	2048/2/15
US TREASURY N/B	3.125	2,400	1,925	285,477	2048/5/15
US TREASURY N/B	3.0	4,100	3,216	476,817	2048/8/15
US TREASURY N/B	3.375	2,950	2,491	369,329	2048/11/15
US TREASURY N/B	3.0	3,300	2,602	385,824	2049/2/15
US TREASURY N/B	2.875	3,000	2,307	342,098	2049/5/15
US TREASURY N/B	2.25	2,950	1,979	293,437	2049/8/15
US TREASURY N/B	2.375	3,100	2,138	316,992	2049/11/15
US TREASURY N/B	2.0	3,700	2,320	343,895	2050/2/15
US TREASURY N/B	1.25	2,450	1,241	183,993	2050/5/15
US TREASURY N/B	1.375	2,570	1,347	199,716	2050/8/15
US TREASURY N/B	1.625	3,000	1,688	250,224	2050/11/15
US TREASURY N/B	1.875	4,750	2,857	423,555	2051/2/15
US TREASURY N/B	2.375	4,100	2,792	413,977	2051/5/15
US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,238	183,608	2051/8/15
US TREASURY N/B	1.875	1,400	838	124,221	2051/11/15
小 計				78,083,916	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	500	481	52,310	2023/11/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.75	590	564	61,400	2024/2/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	790	770	83,699	2024/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	1,450	1,372	149,145	2024/4/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,010	984	106,998	2024/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	650	634	68,973	2024/8/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	795	758	82,437	2024/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.75	800	750	81,577	2024/10/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	610	571	62,128	2025/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	520	489	53,154	2025/4/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	950	909	98,833	2025/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,925	1,743	189,522	2025/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	995	882	95,912	2026/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	770	711	77,285	2026/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,090	981	106,662	2026/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	420	378	41,152	2027/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	850	756	82,189	2027/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	420	403	43,805	2027/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	707	652	70,879	2028/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	540	609	66,287	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	364	337	36,651	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	2,198	1,869	203,175	2030/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,405	1,108	120,469	2030/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,676	1,425	154,950	2031/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,950	1,646	178,976	2031/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	790	694	75,463	2032/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	710	845	91,883	2033/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.0	340	390	42,401	2037/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	4.0	600	623	67,820	2041/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	730	709	77,063	2045/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	750	637	69,276	2048/12/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 権 金 額	
	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
(カナダ) 国債証券					
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	2,403	1,704	185,233	2051/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.75	996	652	70,898	2053/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	335	273	29,736	2064/12/1
小 計				3,078,358	
(メキシコ) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	12,100	11,767	87,707	2023/12/7
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	18,900	18,155	135,324	2024/9/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	16,700	16,606	123,773	2024/12/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	24,250	21,347	159,114	2026/3/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5	3,950	3,332	24,841	2027/3/4
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	20,600	18,803	140,155	2027/6/3
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	17,670	16,499	122,977	2029/5/31
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	21,200	18,603	138,657	2031/5/29
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	5,300	4,496	33,516	2034/11/23
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	3,900	3,909	29,141	2036/11/20
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	12,970	11,421	85,131	2038/11/18
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	13,200	10,638	79,293	2042/11/13
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	13,570	11,097	82,716	2047/11/7
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	2,100	1,702	12,693	2053/7/31
小 計				1,255,043	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BUNDES OBLIGATION	—	1,105	1,085	159,903	2023/10/13
BUNDES OBLIGATION	—	1,300	1,265	186,421	2024/4/5
BUNDES OBLIGATION	—	1,360	1,309	192,943	2024/10/18
BUNDES OBLIGATION	—	1,300	1,240	182,780	2025/4/11
BUNDES OBLIGATION	—	1,045	987	145,556	2025/10/10
BUNDES OBLIGATION	—	1,600	1,498	220,788	2026/4/10
BUNDES OBLIGATION	—	1,250	1,142	168,421	2027/4/16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	790	830	122,318	2024/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,230	1,228	180,987	2024/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,575	1,566	230,795	2024/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	1,790	1,762	259,720	2024/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	870	842	124,141	2025/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	1,740	1,696	250,032	2025/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,820	1,738	256,170	2026/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,900	1,766	260,300	2026/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,795	2,600	383,242	2027/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	910	1,086	160,143	2027/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,580	1,475	217,407	2027/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,150	1,040	153,345	2027/11/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	1,150	1,347	198,575	2028/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,770	1,638	241,418	2028/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	970	1,106	163,039	2028/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,670	1,510	222,656	2028/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,080	957	141,165	2028/11/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,875	1,681	247,773	2029/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,830	1,595	235,072	2029/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	660	842	124,157	2030/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,410	1,216	179,191	2030/2/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	外債建金額	評価額 邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,920	1,638	241,403	2030/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	420	358	52,835	2030/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,110	1,392	205,210	2031/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	2,120	1,788	263,560	2031/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,065	887	130,853	2031/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	333	49,176	2031/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,238	1,017	149,936	2032/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7	100	95	14,126	2032/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,475	1,856	273,639	2034/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,200	902	133,059	2035/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	734	108,219	2036/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	1,790	2,147	316,499	2037/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	1,235	1,546	227,882	2039/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,355	1,814	267,346	2040/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	955	1,089	160,499	2042/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,635	1,688	248,801	2044/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	2,197	2,998	338,740	2046/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	2,040	1,662	244,977	2048/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,330	733	108,120	2050/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	640	354	52,190	2050/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	750	397	58,644	2052/8/15
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	900	881	129,856	2023/12/15
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	830	809	119,278	2024/3/15
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.2	760	739	108,926	2024/6/14
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.45	920	920	135,627	2023/10/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,160	1,140	168,103	2023/10/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	9.0	860	915	134,900	2023/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,110	1,075	158,557	2024/1/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	250	242	35,686	2024/1/30
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,650	1,690	249,172	2024/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,360	1,309	192,909	2024/4/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,075	1,060	156,339	2024/5/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.75	1,180	1,161	171,137	2024/7/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	200	190	28,070	2024/8/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,250	1,272	187,447	2024/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,260	1,227	180,813	2024/11/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,080	1,072	158,021	2024/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	650	612	90,208	2024/12/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,485	1,401	206,594	2025/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,540	1,610	237,377	2025/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	855	821	121,065	2025/5/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.5	1,300	1,250	184,200	2025/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,000	967	142,538	2025/7/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,100	1,079	159,071	2025/11/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,085	1,048	154,448	2025/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.5	850	777	114,534	2026/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,330	1,384	203,955	2026/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,220	1,089	160,497	2026/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.6	1,330	1,254	184,827	2026/6/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	外債建金額	評価額 邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.1	1,220	1,168	172,213	2026/7/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	600	529	77,956	2026/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	7.25	720	828	122,071	2026/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,080	993	146,364	2026/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.85	1,180	1,062	156,571	2027/1/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.1	410	369	54,504	2027/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.2	1,160	1,097	161,771	2027/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.05	995	931	137,241	2027/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,275	1,127	166,149	2027/9/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.5	1,560	1,774	261,471	2027/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,530	1,410	207,834	2028/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.25	1,230	1,023	150,858	2028/3/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.5	1,330	1,110	163,576	2028/7/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,330	1,400	206,445	2028/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,415	1,344	198,082	2028/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.45	1,125	914	134,690	2029/2/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.0	1,655	1,572	231,734	2029/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,750	1,908	281,281	2029/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.5	1,465	1,430	210,752	2030/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.35	975	813	119,858	2030/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,167	930	137,058	2030/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,367	1,142	168,381	2030/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.9	1,375	1,064	156,817	2031/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.0	1,515	1,730	254,954	2031/5/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.6	1,245	923	136,087	2031/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,010	764	112,696	2031/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,610	1,300	191,616	2032/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	950	707	104,310	2032/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.75	1,475	1,650	243,213	2033/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,140	952	140,300	2033/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,580	1,673	246,665	2034/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.35	980	882	130,043	2035/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	900	644	94,988	2036/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.25	965	760	112,028	2036/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.0	2,005	1,940	285,882	2037/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	400	259	38,192	2037/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.95	1,200	1,001	147,633	2038/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,500	1,602	236,202	2039/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.1	610	513	75,618	2040/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,070	1,143	168,440	2040/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.8	830	560	82,576	2041/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,165	1,220	179,876	2044/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.5	440	264	38,918	2045/4/30
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.25	1,120	943	139,096	2046/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.7	970	740	109,081	2047/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.45	1,135	985	145,157	2048/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.85	850	782	115,350	2049/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.45	870	609	89,816	2050/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.7	850	501	73,865	2051/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.15	280	180	26,610	2052/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.8	630	441	65,099	2067/3/1

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	外債換算金額	償還年月日
(ユーロ…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BONI POLIENALI DEL TES	2.15	300	177	26,226	2072/3/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	4.25	2,620	2,676	394,436	2023/10/25
FRANCE (GOVT OF)	—	1,140	1,110	163,596	2024/2/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,390	2,323	342,462	2024/3/25
FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,439	2,445	360,371	2024/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,758	2,736	403,218	2024/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	135	128	18,907	2025/2/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,785	2,643	389,519	2025/3/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,610	2,500	368,512	2025/5/25
FRANCE (GOVT OF)	6.0	2,090	2,317	341,538	2025/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,070	1,997	294,345	2025/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	1,800	1,673	246,536	2026/2/25
FRANCE (GOVT OF)	3.5	2,730	2,847	419,574	2026/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,450	2,404	339,631	2026/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.25	3,010	2,775	409,044	2026/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	1,390	1,260	185,683	2027/2/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,275	2,147	316,523	2027/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.75	3,350	3,414	503,232	2027/10/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	3,715	3,402	501,451	2028/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	3,030	2,754	405,891	2028/11/25
FRANCE (GOVT OF)	5.5	1,975	2,331	343,613	2029/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,990	2,651	390,794	2029/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,580	2,177	320,897	2029/11/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	2,965	2,985	440,009	2030/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	3,049	2,499	368,296	2030/11/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	3,290	3,048	449,274	2031/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,605	2,069	304,976	2031/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,178	1,698	250,269	2032/5/25
FRANCE (GOVT OF)	5.75	2,085	2,636	388,449	2032/10/25
FRANCE (GOVT OF)	2.0	400	375	55,334	2032/11/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,425	2,044	301,242	2034/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.75	1,735	2,057	303,174	2035/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,555	2,072	305,355	2036/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,590	1,776	261,756	2038/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,060	1,733	255,417	2039/6/25
FRANCE (GOVT OF)	4.5	2,780	3,309	487,709	2041/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	960	583	86,029	2044/6/25
FRANCE (GOVT OF)	3.25	1,730	1,779	262,278	2045/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,830	1,490	219,605	2048/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	1,960	1,410	207,902	2050/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,500	852	125,597	2052/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	775	431	63,627	2053/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,300	1,547	228,054	2055/4/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,070	1,287	189,736	2060/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	825	595	87,744	2066/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	515	215	31,692	2072/5/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	880	859	126,683	2024/1/15

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	外債換算金額	償還年月日
(ユーロ…オランダ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	989	989	145,859	2024/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,035	986	145,380	2025/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	250	233	34,427	2026/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,140	1,075	158,501	2026/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	898	820	120,968	2027/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	925	866	127,662	2027/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	775	898	132,454	2028/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	961	884	130,405	2028/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	535	463	68,321	2029/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	645	563	83,106	2029/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	725	608	89,684	2030/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	690	564	83,224	2031/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	570	474	69,867	2032/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	855	854	125,968	2033/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	1,025	1,180	173,966	2037/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	325	218	32,199	2038/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	888	626	92,363	2040/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	1,017	1,181	174,075	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	1,154	1,194	176,056	2047/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	777	390	57,581	2052/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	995	1,017	149,956	2023/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	1,105	1,140	168,119	2024/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,250	1,279	188,555	2024/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,000	966	142,368	2024/5/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	1,100	1,064	156,822	2024/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,520	1,536	226,431	2024/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,350	1,283	189,150	2025/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	1,350	1,327	195,619	2025/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	1,490	1,584	233,445	2025/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	1,455	1,448	213,493	2025/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,315	1,215	179,156	2026/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,055	1,038	153,035	2026/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	1,360	1,530	225,499	2026/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,720	1,644	242,311	2026/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	225	201	29,679	2027/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,475	1,407	207,340	2027/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	1,315	1,208	178,027	2027/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,400	1,320	194,577	2027/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,010	875	128,975	2028/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,270	1,183	174,371	2028/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,275	1,183	174,372	2028/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	1,095	1,235	182,013	2028/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0	1,545	1,836	270,575	2029/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,445	1,328	195,839	2029/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6	1,140	977	144,072	2029/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	1,400	1,174	173,135	2030/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,330	1,238	182,494	2030/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	1,530	1,342	197,836	2030/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.1	1,155	902	133,047	2031/4/30

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		外貨建金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	1,045	833	122,848	2031/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7	1,340	1,071	157,830	2032/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	1,450	1,774	261,479	2032/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.55	645	606	89,372	2032/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	1,235	1,135	167,265	2033/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	1,195	1,005	148,175	2035/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2	1,250	1,356	199,902	2037/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.85	670	462	68,168	2037/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,045	1,239	182,602	2040/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2	1,000	683	100,693	2040/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,300	1,510	222,543	2041/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	300	193	28,474	2042/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	930	1,152	169,799	2044/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,060	946	139,511	2046/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	985	837	123,458	2048/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	1,170	638	94,037	2050/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9	560	378	55,709	2052/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	848	798	117,732	2066/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	345	171	25,288	2071/10/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BELGIUM KINGDOM	0.2	495	486	71,709	2023/10/22
BELGIUM KINGDOM	2.6	845	852	125,687	2024/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.5	670	650	95,816	2024/10/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	1,265	1,224	180,375	2025/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.5	670	721	106,338	2026/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.0	977	937	138,149	2026/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	830	775	114,331	2027/6/22
BELGIUM KINGDOM	—	495	440	64,909	2027/10/22
BELGIUM KINGDOM	5.5	1,070	1,242	183,028	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM	0.8	965	884	130,369	2028/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.9	1,060	958	141,234	2029/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.1	800	666	98,273	2030/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	878	129,420	2031/6/22
BELGIUM KINGDOM	—	640	505	74,539	2031/10/22
BELGIUM KINGDOM	4.0	600	663	97,831	2032/3/28
BELGIUM KINGDOM	0.35	330	263	38,769	2032/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.25	695	602	88,829	2033/4/22
BELGIUM KINGDOM	3.0	543	547	80,668	2034/6/22
BELGIUM KINGDOM	5.0	1,080	1,298	191,347	2035/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.45	425	343	50,582	2037/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.9	485	413	61,001	2038/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.75	160	152	22,446	2039/4/22
BELGIUM KINGDOM	0.4	330	207	30,579	2040/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.25	1,142	1,307	192,610	2041/3/28
BELGIUM KINGDOM	3.75	455	495	73,048	2045/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.6	658	486	71,722	2047/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.7	650	479	70,701	2050/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.4	485	323	47,640	2053/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.25	412	345	50,973	2057/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.15	486	396	58,395	2066/6/22

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		外貨建金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BELGIUM KINGDOM	0.65	270	123	18,136	2071/6/22
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	750	749	110,391	2023/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	555	537	79,139	2024/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	705	700	103,251	2024/10/21
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	400	379	55,883	2025/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	710	688	101,445	2025/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	550	597	88,022	2026/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.0	140	138	20,384	2026/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	963	904	133,354	2026/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	685	627	92,486	2027/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	540	631	92,987	2027/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	660	602	88,719	2028/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	885	774	114,190	2029/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	680	557	82,121	2030/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	665	528	77,835	2031/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.9	400	335	49,452	2032/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	515	486	71,684	2034/5/23
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	270	185	27,363	2036/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	840	941	138,722	2037/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	345	201	29,647	2040/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	394	404	59,614	2044/6/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	503	376	55,437	2047/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.85	170	136	20,090	2049/5/23
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	405	237	35,016	2051/3/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	190	223	32,911	2062/1/26
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7	200	90	13,312	2071/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	173	105	15,579	2086/11/2
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	403	302	44,618	2117/9/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.85	192	85	12,574	2120/6/30
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
FINNISH GOVERNMENT	2.0	250	250	36,893	2024/4/15
FINNISH GOVERNMENT	—	255	245	36,230	2024/9/15
FINNISH GOVERNMENT	4.0	382	400	59,085	2025/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.875	280	270	39,787	2025/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	435	410	60,424	2026/4/15
FINNISH GOVERNMENT	—	100	91	13,458	2026/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.375	120	114	16,860	2027/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	400	363	53,593	2027/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.75	380	382	56,416	2028/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.5	270	238	35,190	2028/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	375	324	47,784	2029/9/15
FINNISH GOVERNMENT	—	172	139	20,540	2030/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.75	535	455	67,179	2031/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	125	99	14,661	2031/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.5	65	57	8,478	2032/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.125	325	268	39,520	2034/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	278	191	28,146	2036/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.25	263	163	24,151	2040/9/15

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
FINNISH GOVERNMENT	2.625	277	261	38,495	2042/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.5	210	131	19,372	2043/4/15
FINNISH GOVERNMENT	1.375	260	194	28,650	2047/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	250	118	17,529	2052/4/15
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH TREASURY	3.4	460	468	69,051	2024/3/18
IRISH TREASURY	5.4	580	623	91,943	2025/3/13
IRISH TREASURY	1.0	655	630	92,931	2026/5/15
IRISH TREASURY	0.2	395	360	53,113	2027/5/15
IRISH TREASURY	0.9	520	480	70,863	2028/5/15
IRISH TREASURY	1.1	600	554	81,722	2029/5/15
IRISH TREASURY	2.4	546	545	80,338	2030/5/15
IRISH TREASURY	0.2	282	236	34,808	2030/10/18
IRISH TREASURY	1.35	475	437	64,454	2031/3/18
IRISH TREASURY	—	485	386	57,009	2031/10/18
IRISH TREASURY	0.35	205	164	24,213	2032/10/18
IRISH TREASURY	1.3	285	249	36,700	2033/5/15
IRISH TREASURY	0.4	310	232	34,212	2035/5/15
IRISH TREASURY	1.7	390	333	49,114	2037/5/15
IRISH TREASURY	0.55	250	162	23,893	2041/4/22
IRISH TREASURY	2.0	541	450	66,386	2045/2/18
IRISH TREASURY	1.5	464	331	48,879	2050/5/15
ユーロ計				50,837,708	
(イギリス) 国債証券					
UK TREASURY	0.125	1,230	1,182	200,450	2024/1/31
UK TREASURY	1.0	1,030	995	168,773	2024/4/22
UK TREASURY	2.75	875	865	146,754	2024/9/7
UK TREASURY	0.25	930	862	146,183	2025/1/31
UK TREASURY	5.0	1,205	1,245	211,083	2025/3/7
UK TREASURY	0.625	813	756	128,239	2025/6/7
UK TREASURY	0.125	710	635	107,679	2026/1/30
UK TREASURY	1.5	820	759	128,825	2026/7/22
UK TREASURY	0.375	710	623	105,675	2026/10/22
UK TREASURY	1.25	840	750	127,144	2027/7/22
UK TREASURY	4.25	850	866	146,893	2027/12/7
UK TREASURY	0.125	745	617	104,596	2028/1/31
UK TREASURY	1.625	720	640	108,511	2028/10/22
UK TREASURY	6.0	710	793	134,586	2028/12/7
UK TREASURY	0.5	565	461	78,308	2029/1/31
UK TREASURY	0.875	856	707	119,976	2029/10/22
UK TREASURY	0.375	920	711	120,571	2030/10/22
UK TREASURY	4.75	1,005	1,084	183,778	2030/12/7
UK TREASURY	0.25	1,365	1,016	172,342	2031/7/31
UK TREASURY	1.0	305	240	40,742	2032/1/31
UK TREASURY	4.25	1,370	1,438	243,789	2032/6/7
UK TREASURY	0.875	370	276	46,790	2033/7/31
UK TREASURY	4.5	849	909	154,188	2034/9/7
UK TREASURY	0.625	1,007	684	116,012	2035/7/31
UK TREASURY	4.25	970	1,008	170,955	2036/3/7

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
	%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
(イギリス) 国債証券					
UK TREASURY	1.75	1,350	1,019	172,874	2037/9/7
UK TREASURY	4.75	1,060	1,162	197,066	2038/12/7
UK TREASURY	4.25	970	1,003	170,183	2039/9/7
UK TREASURY	4.25	935	972	164,807	2040/12/7
UK TREASURY	1.25	820	531	90,088	2041/10/22
UK TREASURY	4.5	1,090	1,181	200,227	2042/12/7
UK TREASURY	3.25	1,175	1,067	181,005	2044/1/22
UK TREASURY	3.5	1,160	1,094	185,496	2045/1/22
UK TREASURY	0.875	435	239	40,586	2046/1/31
UK TREASURY	4.25	920	977	165,643	2046/12/7
UK TREASURY	1.5	1,340	853	144,648	2047/7/22
UK TREASURY	1.75	675	453	76,871	2049/1/22
UK TREASURY	4.25	895	967	164,065	2049/12/7
UK TREASURY	0.625	660	311	52,842	2050/10/22
UK TREASURY	1.25	300	171	29,070	2051/7/31
UK TREASURY	3.75	872	882	149,580	2052/7/22
UK TREASURY	1.625	635	397	67,450	2054/10/22
UK TREASURY	4.25	962	1,079	182,964	2055/12/7
UK TREASURY	1.75	1,075	696	118,013	2057/7/22
UK TREASURY	4.0	751	823	139,590	2060/1/22
UK TREASURY	0.5	830	326	55,308	2061/10/22
UK TREASURY	3.5	830	849	143,968	2068/7/22
UK TREASURY	1.625	650	398	67,614	2071/10/22
UK TREASURY	1.125	473	232	39,454	2073/10/22
UNITED KINGDOM GILT	2.0	605	582	98,691	2025/9/7
UNITED KINGDOM GILT	2.5	882	703	119,281	2065/7/22
小 計				6,630,252	
(スウェーデン) 国債証券					
SWEDISH GOVERNMENT	1.5	5,900	5,856	79,010	2023/11/13
SWEDISH GOVERNMENT	2.5	4,420	4,429	59,754	2025/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	1.0	4,700	4,452	60,070	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,550	3,260	43,990	2028/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,780	3,402	45,893	2029/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.125	2,600	2,180	29,421	2031/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	2.25	1,800	1,815	24,495	2032/6/1
SWEDISH GOVERNMENT	3.5	2,985	3,548	47,863	2039/3/30
小 計				390,499	
(ノルウェー) 国債証券					
NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	3,820	3,793	53,863	2024/3/14
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	3,190	3,058	43,434	2025/3/13
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	2,750	2,570	36,499	2026/2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,400	2,221	31,541	2027/2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	2,340	2,148	30,504	2028/4/26
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,250	1,993	28,305	2029/9/6
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	3,150	2,667	37,881	2030/8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.25	2,040	1,669	23,713	2031/9/17
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.125	1,900	1,670	23,720	2032/5/18
小 計				309,464	

銘柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	千円
(デンマーク) 国債証券				
KINGDOM OF DENMARK	1.5	3,190	3,175	62,896
KINGDOM OF DENMARK	—	1,260	1,205	23,879
KINGDOM OF DENMARK	1.75	3,370	3,319	65,752
KINGDOM OF DENMARK	0.5	4,310	3,926	77,785
KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,830	2,472	48,970
KINGDOM OF DENMARK	—	1,150	915	18,130
KINGDOM OF DENMARK	4.5	9,450	11,731	232,392
KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,300	692	13,717
小 計				543,525
(ポーランド) 国債証券				
POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,650	1,590	49,176
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,110	1,950	60,312
POLAND GOVERNMENT BOND	—	310	270	8,350
POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	1,980	1,770	54,741
POLAND GOVERNMENT BOND	0.75	1,440	1,206	37,313
POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2,570	2,258	69,848
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,590	2,117	65,483
POLAND GOVERNMENT BOND	0.25	1,950	1,431	44,264
POLAND GOVERNMENT BOND	3.75	460	383	11,849
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,140	1,675	51,807
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,160	1,663	51,448
POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	555	493	15,248
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,665	1,929	59,682
POLAND GOVERNMENT BOND	1.25	2,025	1,237	38,283
POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	1,300	772	23,904
小 計				641,714
(オーストラリア) 国債証券				
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	755	748	70,777
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	1,715	1,605	151,778
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,000	994	93,972
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	950	859	81,218
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	1,130	1,154	109,075
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.5	1,310	1,161	109,773
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	1,170	1,221	115,435
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	980	935	88,419
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	850	784	74,162
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	720	678	64,101
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	930	897	84,790
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	890	826	78,098
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	1,300	1,176	111,218
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	1,180	934	88,352
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5	1,378	1,125	106,335
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	1,790	1,378	130,312
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.25	1,580	1,230	116,305
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	1,270	1,028	97,174
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,035	1,072	101,330
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	790	712	67,295
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	530	453	42,898
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	750	705	66,643

銘柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	千円
(オーストラリア) 国債証券				
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	582	504	47,689
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	790	622	58,810
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	720	565	53,440
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	1,020	579	54,783
小 計				2,264,192
(シンガポール) 国債証券				
SINGAPORE GOVERNMENT	2.0	560	551	57,670
SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	540	538	56,242
SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	470	460	48,093
SINGAPORE GOVERNMENT	0.5	229	210	22,020
SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	470	450	47,125
SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	205	188	19,730
SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	533	535	55,910
SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	290	277	29,014
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	450	432	45,238
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	540	516	53,924
SINGAPORE GOVERNMENT	1.625	300	257	26,935
SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	120	111	11,633
SINGAPORE GOVERNMENT	3.75	355	351	36,745
SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	501	437	45,725
SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	220	193	20,208
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	287	266	27,894
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	332	310	32,438
SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	367	282	29,473
SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	150	115	12,068
SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	140	137	14,392
小 計				692,485
(マレーシア) 国債証券				
MALAYSIA GOVERNMENT	3.478	775	773	24,239
MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	830	836	26,208
MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	530	529	16,587
MALAYSIA GOVERNMENT	3.955	1,550	1,549	48,542
MALAYSIA GOVERNMENT	3.906	780	774	24,251
MALAYSIA GOVERNMENT	3.9	1,070	1,058	33,174
MALAYSIA GOVERNMENT	3.899	920	905	28,359
MALAYSIA GOVERNMENT	3.895	1,320	1,274	39,925
MALAYSIA GOVERNMENT	2.632	985	852	26,691
MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	700	694	21,768
MALAYSIA GOVERNMENT	3.828	1,100	1,009	31,634
MALAYSIA GOVERNMENT	4.254	960	912	28,570
MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	1,170	1,177	36,890
MALAYSIA GOVERNMENT	4.893	590	592	18,554
MALAYSIA GOVERNMENT	3.757	1,490	1,285	40,282
MALAYSIA GOVERNMENT	4.696	200	194	6,099
MALAYSIA GOVERNMENT	4.935	660	658	20,626
MALAYSIA GOVERNMENT	4.736	750	723	22,661
MALAYSIA GOVERNMENT	4.921	510	501	15,715
MALAYSIA GOVERNMENT	4.065	1,560	1,340	42,004
MALAYSIA GOVERNMENT	4.181	800	807	25,290

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
(マレーシア) 国債証券	%	千リンギット	千リンギット	千円	
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	750	763	23,909	2026/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.892	330	326	10,214	2027/3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	950	920	28,838	2027/5/31
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,620	1,566	49,059	2028/6/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	910	906	28,409	2030/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	1,035	1,004	31,462	2031/6/30
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	980	912	28,571	2033/4/15
小 計				778,544	
(中国) 国債証券		千中国人民元	千中国人民元		
CHINA GOVERNMENT BOND	3.29	7,000	7,109	144,945	2023/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND	2.88	12,000	12,131	247,319	2023/11/5
CHINA GOVERNMENT BOND	3.19	14,000	14,272	291,069	2024/4/11
CHINA GOVERNMENT BOND	2.47	11,000	11,087	225,937	2024/9/2
CHINA GOVERNMENT BOND	2.94	8,000	8,141	165,975	2024/10/17
CHINA GOVERNMENT BOND	1.99	13,000	12,928	263,572	2025/4/9
CHINA GOVERNMENT BOND	2.18	7,000	6,983	142,379	2025/8/25
CHINA GOVERNMENT BOND	3.02	9,000	9,203	187,633	2025/10/22
CHINA GOVERNMENT BOND	3.03	12,000	12,284	250,433	2026/3/11
CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	12,000	12,124	247,181	2026/8/12
CHINA GOVERNMENT BOND	3.12	8,000	8,222	167,641	2026/12/5
CHINA GOVERNMENT BOND	2.85	19,000	19,301	393,495	2027/6/4
CHINA GOVERNMENT BOND	3.28	5,000	5,195	105,919	2027/12/3
CHINA GOVERNMENT BOND	3.01	12,000	12,280	250,355	2028/5/13
CHINA GOVERNMENT BOND	2.91	8,000	8,130	165,764	2028/10/14
CHINA GOVERNMENT BOND	3.29	14,000	14,607	297,792	2029/5/23
CHINA GOVERNMENT BOND	2.68	11,000	10,949	223,236	2030/5/21
CHINA GOVERNMENT BOND	3.27	8,000	8,326	169,748	2030/11/19
CHINA GOVERNMENT BOND	3.02	5,000	5,098	103,937	2031/5/27

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
(中国) 国債証券	%	千中国人民元	千中国人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND	2.75	8,000	7,986	162,825	2032/2/17
CHINA GOVERNMENT BOND	2.76	6,000	6,014	122,627	2032/5/15
CHINA GOVERNMENT BOND	3.81	6,000	6,701	136,621	2050/9/14
CHINA GOVERNMENT BOND	3.72	6,000	6,616	134,890	2051/4/12
CHINA GOVERNMENT BOND	3.53	7,000	7,484	152,576	2051/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND	3.32	7,000	7,239	147,587	2052/4/15
小 計				4,901,467	
(イスラエル) 国債証券		千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
ISRAEL FIXED BOND	1.5	760	748	31,513	2023/11/30
ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,420	1,431	60,274	2024/3/31
ISRAEL FIXED BOND	0.4	280	265	11,154	2024/10/31
ISRAEL FIXED BOND	0.5	1,360	1,273	53,607	2025/4/30
ISRAEL FIXED BOND	1.75	1,240	1,191	50,148	2025/8/31
ISRAEL FIXED BOND	0.5	530	484	20,406	2026/2/27
ISRAEL FIXED BOND	6.25	950	1,056	44,468	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND	2.0	1,270	1,205	50,735	2027/3/31
ISRAEL FIXED BOND	2.25	1,040	982	41,342	2028/9/28
ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,515	1,288	54,244	2030/3/31
ISRAEL FIXED BOND	1.3	150	125	5,288	2032/4/30
ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,050	810	34,111	2037/5/31
ISRAEL FIXED BOND	5.5	1,160	1,470	61,901	2042/1/31
ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,300	1,305	54,970	2047/3/31
小 計				574,169	
合 計				150,981,343	

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 150,981,343	% 99.1
コール・ローン等、その他	1,399,855	0.9
投資信託財産総額	152,381,198	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（152,311,600千円）の投資信託財産総額（152,381,198千円）に対する比率は100.0%です。

(注) 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。1アメリカドル=148.23円、1カナダドル=108.69円、1メキシコペソ=7.4535円、1ユーロ=147.36円、1イギリスポンド=169.52円、1スウェーデンクローナ=13.49円、1ノルウェークローネ=14.20円、1デンマーククローネ=19.81円、1ポーランドズロチ=30.9265円、1オーストラリアドル=94.51円、1シンガポールドル=104.50円、1マレーシアリンギット=31.3271円、1中国人民元=20.3869円、1イスラエルシェケル=42.0932円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	152,435,276,404	
コール・ローン等	187,557,731	
公社債（評価額）	150,981,343,458	
未収入金	128,093,818	
未収利息	1,091,775,551	
前払費用	46,505,846	
(B) 負債	161,140,093	
未払金	54,150,439	
未払解約金	106,989,541	
未払利息	113	
(C) 純資産総額（A－B）	152,274,136,311	
元本	57,575,300,165	
次期繰越損益金	94,698,836,146	
(D) 受益権総口数	57,575,300,165口	
1万口当たり基準価額（C/D）	26,448円	

(注) 当ファンドの期首元本額は61,672,878,643円、期中追加設定元本額は3,281,227,327円、期中一部解約元本額は7,378,805,805円です。

(注) 2022年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	16,979,582,310円
・インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	16,794,261,878円
・日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	13,154,930,712円
・インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	3,607,947,517円
・世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,355,333,711円
・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	835,698,012円
・DCインデックスバランス（株式60）	682,975,875円
・国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	588,340,485円
・DCインデックスバランス（株式80）	560,018,801円
・DCインデックスバランス（株式40）	515,032,949円
・DCインデックスバランス（株式20）	389,007,488円
・海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	302,327,311円
・財産3分法（適格機関投資家専用）	203,841,699円
・世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	173,659,188円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	144,328,916円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	84,495,854円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	82,606,618円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式30）	62,113,777円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	58,797,064円

(注) 1口当たり純資産額は2,6448円です。

○損益の状況（2021年10月27日～2022年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	3,378,114,420	
受取利息	3,378,307,036	
その他収益金	147,788	
支払利息	△ 340,404	
(B) 有価証券売買損益	177,994,410	
売買益	31,355,023,154	
売買損	△31,177,028,744	
(C) 保管費用等	△ 25,212,768	
(D) 当期損益金（A+B+C）	3,530,896,062	
(E) 前期繰越損益金	97,543,427,122	
(F) 追加信託差損益金	5,208,060,902	
(G) 解約差損益金	△11,583,547,940	
(H) 計（D+E+F+G）	94,698,836,146	
次期繰越損益金（H）	94,698,836,146	

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(G)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。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2021年10月27日から2022年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。