

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 | み 期 金 騰 | 中 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 |

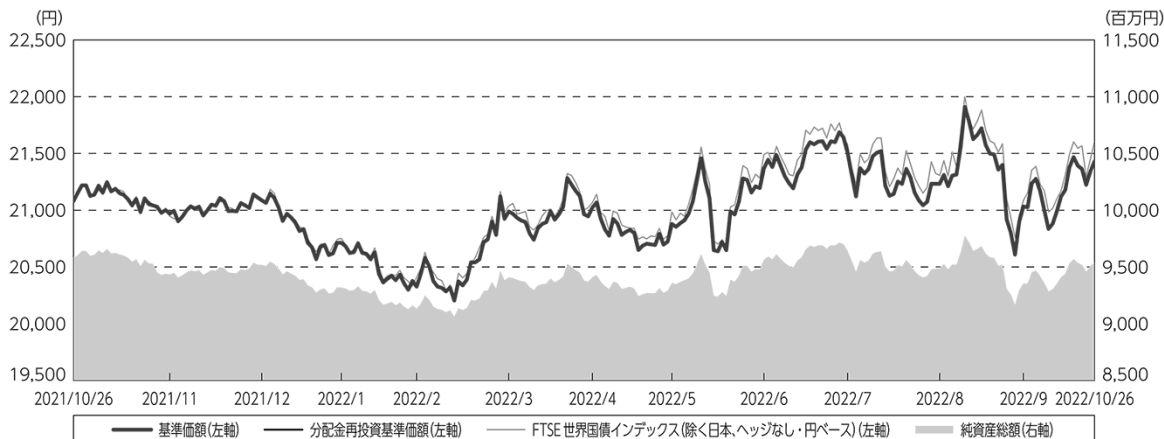
(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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



期首：21,081円

期末：21,430円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 1.7%（分配金再投資ベース）

- (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

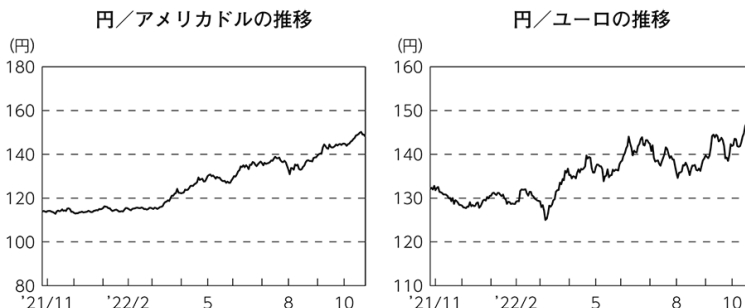
（海外債券市況）

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。



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。

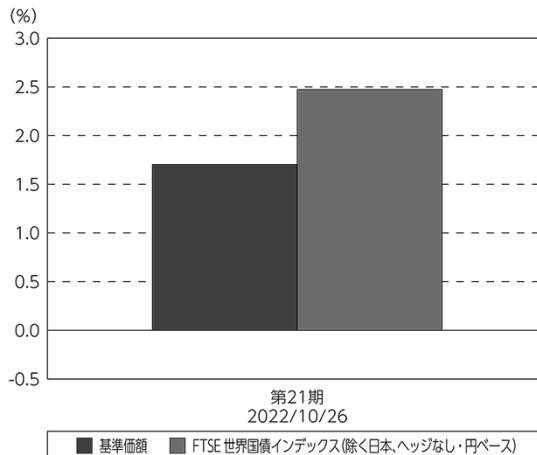
＜プラス要因＞

- ・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。

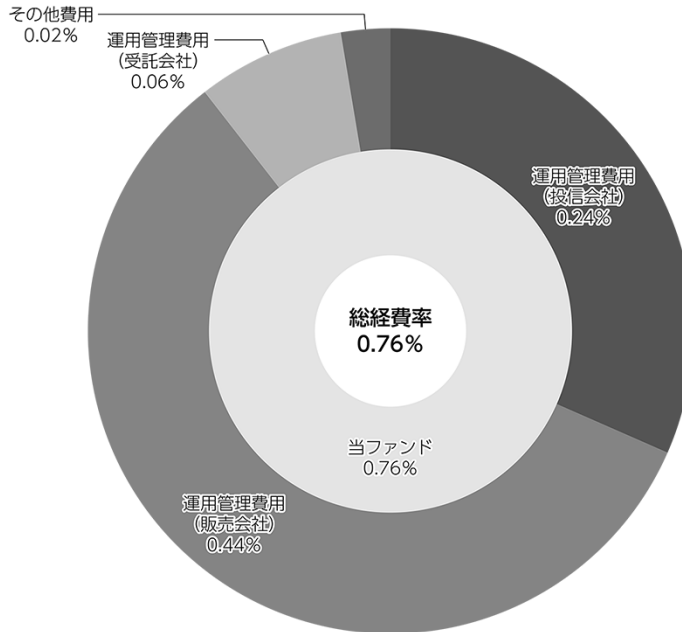
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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マレーシアリンギット=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。

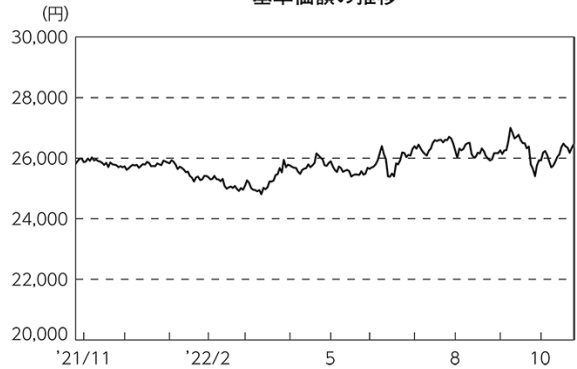
<値上がり要因>

- ・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

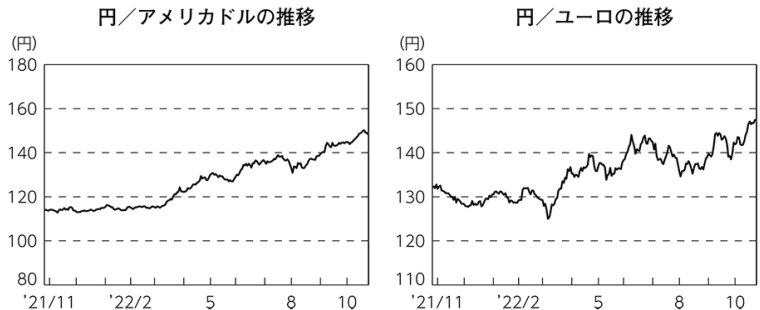
（海外債券市況）

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。

○売買及び取引の状況

（2021年10月27日～2022年10月26日）

公社債

| | | | 買付額 | 売付額 |
|-------|---------|--------|-----------------------|-----------------------|
| 外 | アメリカ | 国債証券 | 千アメリカドル 137,462 | 千アメリカドル 157,414 |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダドル 9,698 | 千カナダドル 11,367 |
| | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコペソ 14,522 | 千メキシコペソ 24,181 |
| | ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | ドイツ | 国債証券 | 8,969 | 18,332 |
| | イタリア | 国債証券 | 6,886 | 19,720 |
| | フランス | 国債証券 | 6,660 | 18,769 |
| | オランダ | 国債証券 | 1,967 | 4,306 |
| | スペイン | 国債証券 | 3,530 | 10,897 |
| | ベルギー | 国債証券 | 1,382 | 3,434 |
| | オーストリア | 国債証券 | 1,611 | 3,233 |
| | フィンランド | 国債証券 | 676 | 1,447 |
| | アイルランド | 国債証券 | 434 | 2,019 |
| | イギリス | 国債証券 | 千イギリスポンド 4,248 | 千イギリスポンド 11,665 |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデンクローナ - | 千スウェーデンクローナ 3,928 |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェークローネ 1,887 | 千ノルウェークローネ 7,697 |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーククローネ - | 千デンマーククローネ 10,311 |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ポーランドズロチ 2,026 | 千ポーランドズロチ 5,556 |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリアドル 1,788 | 千オーストラリアドル 7,608 |
| | 国 | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポールドル 1,275 |
| マレーシア | | 国債証券 | 千マレーシアリングgit 2,974 | 千マレーシアリングgit 4,829 |
| 中国 | | 国債証券 | 千中国人民元 250,700 | 千中国人民元 12,105 |
| イスラエル | | 国債証券 | 千イスラエルシェケル 410 | 千イスラエルシェケル 5,204 |

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2021年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 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 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 | 外 債 建 立 額 | |
| | % | 千アメリカドル | 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 | | | | | |
| 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 | 外 債 建 立 額 | |
| | % | 千カナダドル | 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 | | | | | |
| 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 | | | | | |
| 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 | 評価額 | 価額 | |
| | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| (ユーロ…ドイツ) 国債証券 | | | | | |
| 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 | 評価額 | 価額 | |
| | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| (ユーロ…イタリア) 国債証券 | | | | | |
| 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 | 外貨建金額 | 評価価額 邦貨換算金額 | 償還年月日 |
| (ユーロ…フィンランド) 国債証券 | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| 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 | | 千ポンド | 千ポンド | | |
| 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 | 外貨建金額 | 評価価額 邦貨換算金額 | 償還年月日 |
| (イギリス) 国債証券 | % | 千ポンド | 千ポンド | 千円 | |
| 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 | | 千クローナ | 千クローナ | | |
| 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 | | 千ノルウェークローナ | 千ノルウェークローナ | | |
| 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 | 2023/11/15 |
| KINGDOM OF DENMARK | — | 1,260 | 1,205 | 2024/11/15 |
| KINGDOM OF DENMARK | 1.75 | 3,370 | 3,319 | 2025/11/15 |
| KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 4,310 | 3,926 | 2027/11/15 |
| KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 2,830 | 2,472 | 2029/11/15 |
| KINGDOM OF DENMARK | — | 1,150 | 915 | 2031/11/15 |
| KINGDOM OF DENMARK | 4.5 | 9,450 | 11,731 | 2039/11/15 |
| KINGDOM OF DENMARK | 0.25 | 1,300 | 692 | 2052/11/15 |
| 小 計 | | | 543,525 | |
| (ポーランド) 国債証券 | | | | |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 4.0 | 1,650 | 1,590 | 2023/10/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 2,110 | 1,950 | 2024/4/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | — | 310 | 270 | 2024/7/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.25 | 1,980 | 1,770 | 2024/10/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 0.75 | 1,440 | 1,206 | 2025/4/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 2,570 | 2,258 | 2025/7/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 2,590 | 2,117 | 2026/7/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 0.25 | 1,950 | 1,431 | 2026/10/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 3.75 | 460 | 383 | 2027/5/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 2,140 | 1,675 | 2027/7/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75 | 2,160 | 1,663 | 2028/4/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 555 | 493 | 2029/4/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75 | 2,665 | 1,929 | 2029/10/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 1.25 | 2,025 | 1,237 | 2030/10/25 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 1.75 | 1,300 | 772 | 2032/4/25 |
| 小 計 | | | 641,714 | |
| (オーストラリア) 国債証券 | | | | |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 755 | 748 | 2024/4/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 0.25 | 1,715 | 1,605 | 2024/11/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 1,000 | 994 | 2025/4/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 0.25 | 950 | 859 | 2025/11/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 1,130 | 1,154 | 2026/4/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 0.5 | 1,310 | 1,161 | 2026/9/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75 | 1,170 | 1,221 | 2027/4/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 980 | 935 | 2027/11/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.25 | 850 | 784 | 2028/5/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 720 | 678 | 2028/11/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 930 | 897 | 2029/4/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 890 | 826 | 2029/11/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.5 | 1,300 | 1,176 | 2030/5/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0 | 1,180 | 934 | 2030/12/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.5 | 1,378 | 1,125 | 2031/6/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0 | 1,790 | 1,378 | 2031/11/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.25 | 1,580 | 1,230 | 2032/5/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.75 | 1,270 | 97,174 | 2032/11/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 1,035 | 1,072 | 2033/4/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0 | 790 | 712 | 2033/11/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 530 | 453 | 2035/6/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.75 | 750 | 705 | 2037/4/21 |

| 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 | 2039/6/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 790 | 622 | 2041/5/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0 | 720 | 565 | 2047/3/21 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.75 | 1,020 | 579 | 2051/6/21 |
| 小 計 | | | 2,264,192 | |
| (シンガポール) 国債証券 | | | | |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.0 | 560 | 551 | 2024/2/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 540 | 538 | 2024/9/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.375 | 470 | 460 | 2025/6/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 0.5 | 229 | 210 | 2025/11/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.125 | 470 | 450 | 2026/6/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 1.25 | 205 | 188 | 2026/11/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5 | 533 | 535 | 2027/3/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.625 | 290 | 277 | 2028/5/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 450 | 432 | 2029/7/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 540 | 516 | 2030/9/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 1.625 | 300 | 257 | 2031/7/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.625 | 120 | 111 | 2032/8/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 3.75 | 355 | 351 | 2036/3/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.25 | 501 | 437 | 2036/8/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.375 | 220 | 193 | 2039/7/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 287 | 266 | 2027/8/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 332 | 310 | 2028/4/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 1.875 | 367 | 282 | 2029/3/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 1.875 | 150 | 115 | 2051/10/1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 140 | 137 | 2072/8/1 |
| 小 計 | | | 692,485 | |
| (マレーシア) 国債証券 | | | | |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.478 | 775 | 773 | 2024/6/14 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.059 | 830 | 836 | 2024/9/30 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.882 | 530 | 529 | 2025/3/14 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.955 | 1,550 | 1,549 | 2025/9/15 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.906 | 780 | 774 | 2026/7/15 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.9 | 1,070 | 1,058 | 2026/11/30 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.899 | 920 | 905 | 2028/11/16 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.895 | 1,320 | 1,274 | 2029/8/15 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 2.632 | 985 | 852 | 2031/4/15 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.642 | 700 | 694 | 2033/11/7 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.28 | 1,100 | 1,009 | 2034/7/5 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.254 | 960 | 912 | 2035/5/31 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.762 | 1,170 | 1,177 | 2037/4/7 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.893 | 590 | 592 | 2038/6/8 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.757 | 1,490 | 1,285 | 2040/5/22 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.696 | 200 | 194 | 2042/10/15 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.935 | 660 | 658 | 2043/9/30 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.736 | 750 | 723 | 2046/3/15 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.921 | 510 | 501 | 2048/7/6 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.065 | 1,560 | 1,340 | 2050/6/15 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.181 | 800 | 807 | 2024/7/15 |

| 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 | 14,277 | 291,069 | 2024/4/11 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.47 | 11,000 | 11,082 | 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。