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	信託期間は2003年1月15日から無期限です。	
運用方針	確定拠出年金法(平成13年法律第88号)に基づく確定拠出年金専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)を行使したものに限ることとし、実質投資割合は取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	外国債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
分配方針	年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。 分配対象額は、経費控除後の利子等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の合計額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

DC外国債券インデックスファンドL

運用報告書（全体版）

第23期（決算日　2025年10月24日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011　東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ　https://www.smtam.jp/

■口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
■当運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

＜110021＞

【本運用報告書の記載について】
・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
第19期(2021年10月25日)	20,139	0	5.0	515.549	5.0	97.5	1.7	37,210
第20期(2022年10月24日)	20,376	0	1.2	525.265	1.9	98.3	0.7	39,634
第21期(2023年10月24日)	21,129	0	3.7	543.784	3.5	98.3	0.5	40,620
第22期(2024年10月24日)	23,512	0	11.3	608.118	11.8	98.3	0.3	47,629
第23期(2025年10月24日)	25,036	0	6.5	647.975	6.6	98.3	0.3	49,875

(注1)基準価額の騰落率は分配金込みです。
(注2)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」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当期中の基準価額と市況の推移

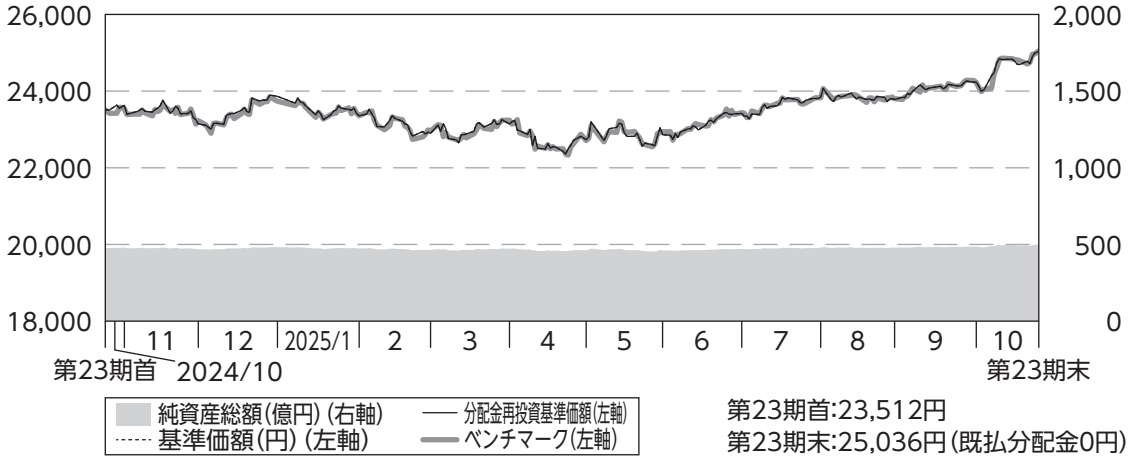
年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2024年10月24日	23,512	－	608.118	－	98.3	0.3
10月末	23,628	0.5	608.878	0.1	98.2	0.4
11月末	23,143	△1.6	600.817	△1.2	97.9	0.6
12月末	23,861	1.5	613.976	1.0	98.1	0.6
2025年 1月末	23,359	△0.7	604.077	△0.7	97.9	0.6
2月末	22,900	△2.6	593.912	△2.3	97.8	0.7
3月末	23,141	△1.6	601.106	△1.2	98.0	0.6
4月末	22,736	△3.3	587.354	△3.4	98.1	0.6
5月末	22,861	△2.8	593.189	△2.5	98.0	0.3
6月末	23,420	△0.4	606.217	△0.3	98.3	0.4
7月末	23,841	1.4	616.336	1.4	98.0	0.6
8月末	23,784	1.2	615.622	1.2	98.0	0.6
9月末	24,232	3.1	626.648	3.0	98.2	0.3
(当期末)						
2025年10月24日	25,036	6.5	647.975	6.6	98.3	0.3

(注1)期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2)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」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。
【FTSE世界国債インデックス】は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

基準価額等の推移



第23期首:23,512円
第23期末:25,036円(既払分配金0円)
騰落率:6.5%(分配金再投資ベース)

(注1)分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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2)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、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
(注3)分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2024年10月24日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

投資環境

外国債券市場において、主要国の長期金利は期を通してみると横ばいで推移しました。
トランプ政権の関税政策に伴う景気後退懸念の高まりや、米雇用統計が労働市場の減速を示し、FRB(米連邦準備理事会)による利下げ観測が強まったことが、長期金利の低下(債券価格は上昇)要因となりました。一方、米物価指標の高止まりなどが長期金利の上昇要因となりました。
外国為替市場では、日銀が早期に追加利上げに動くとの見方が後退したことなどを受けて投資国通貨は対円で上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動することを目的とする「外国債券マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れ、運用しました。

【「外国債券マザーファンド」の運用経過】
ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。
(1)債券組入比率
先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は、ヘッジ目的で債券先物取引と為替予約取引を利用しました。
(2)ポートフォリオ構成
ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

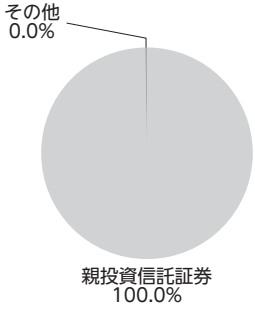
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

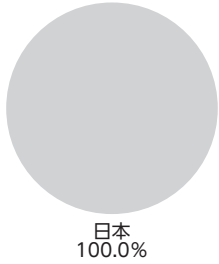
	当期末
	2025年10月24日
外国債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

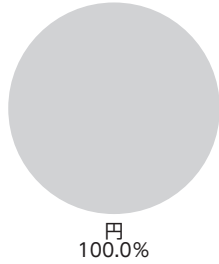
○資産別配分



○国別配分



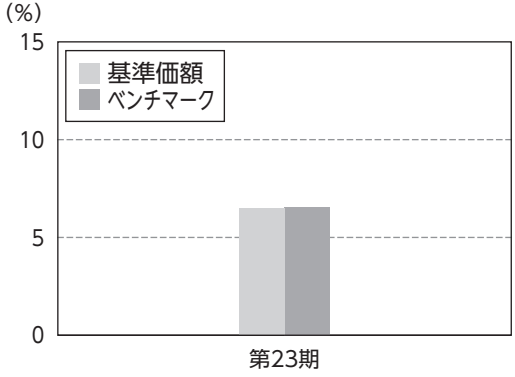
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。
ベンチマークとの乖離が生じた主なマイナス要因は、信託報酬等です。

分配金

長期的な信託財産の成長を図るため、収益分配は見送りとさせていただきました。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（1万口当たり・税引前）

項目		第23期 2024年10月25日～2025年10月24日
当期分配金	（円）	－
（対基準価額比率）	（％）	（－）
当期の収益	（円）	－
当期の収益以外	（円）	－
翌期繰越分配対象額	（円）	16,007

（注1）「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注3）－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に分散投資を行い、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

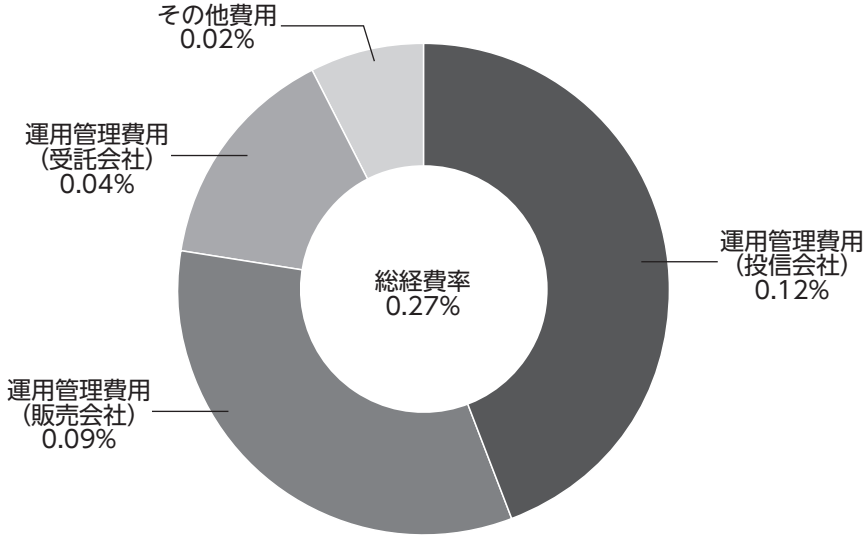
項目	当期 (2024年10月25日～2025年10月24日) 金額	比率	項目の概要
(a)信託報酬	**59円**	**0.253%**	(a)信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は23,408円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。
(投信会社)	(28)	(0.121)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販売会社)	(21)	(0.088)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(10)	(0.044)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b)売買委託手数料	**0**	**0.000**	(b)売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c)有価証券取引税	**－**	**－**	(c)有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d)その他費用	**4**	**0.017**	(d)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(4)	(0.017)	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)	(－)	(－)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	**63**	**0.270**	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

＜参考情報＞

総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.27%です。



（注1）各費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
（注2）各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
（注3）各比率は、年率換算した値です。
（注4）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

〈親投資信託受益証券の設定、解約状況〉

	当期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国債券マザーファンド	830,078	2,611,361	1,116,322	3,510,303

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	0.089483	0.089483	100.0	0.089483	0.089483	100.0
コール・ローン	20,754	2,544	12.3	20,735	2,555	12.3

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

〈外国債券マザーファンド〉

区分	当期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	22,822	22,822	100.0	22,984	22,984	100.0
為替直物取引	8,027	7,993	99.6	9,692	9,625	99.3
金銭信託	2	2	100.0	2	2	100.0
コール・ローン	286,995	36,977	12.9	287,013	37,107	12.9

〈平均保有割合　24.9%〉
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

〈親投資信託残高〉

種類	当期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券マザーファンド	15,055,588	14,769,343	49,850,966

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、59,808,763千口です。

※ 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。

投資信託財産の構成

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
外国債券マザーファンド	49,850,966	99.7
コール・ローン等、その他	133,235	0.3
投資信託財産総額	49,984,201	100.0

(注1)外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(200,938,336千円)の投資信託財産総額(201,941,210千円)に対する比率は99.5%です。
(注2)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=152.69円	1カナダドル=109.13円	1メキシコペソ=8.302円
1ユーロ=177.38円	1イギリスポンド=203.52円	1スウェーデンクローナ=16.29円
1ノルウェークローネ=15.32円	1デンマーククローネ=23.75円	1ポーランドズロチ=41.929円
1オーストラリアドル=99.46円	1ニュージーランドドル=87.86円	1シンガポールドル=117.61円
1マレーシアリンギット=36.1589円	1オフショア人民元=21.4291円	1イスラエルシェケル=46.4449円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2025年10月24日現在
(A) 資産	**49,984,201,593円**
コール・ローン等	125,176,183
外国債券マザーファンド(評価額)	49,850,966,469
未収入金	8,057,334
未収利息	1,607
(B) 負債	**108,336,939**
未払解約金	48,061,097
未払信託報酬	60,275,842
(C) 純資産総額(A-B)	**49,875,864,654**
元本	19,921,349,785
次期繰越損益金	29,954,514,869
(D) 受益権総口数	**19,921,349,785口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**25,036円**

■損益の状況

項目	当期 自 2024年10月25日 至 2025年10月24日
(A) 配当等収益	**349,098円**
受取利息	349,098
(B) 有価証券売買損益	**3,170,529,252**
売買益	3,302,554,910
売買損	△132,025,658
(C) 信託報酬等	**△119,804,946**
(D) 当期損益金(A+B+C)	**3,051,073,404**
(E) 前期繰越損益金	**7,873,031,553**
(F) 追加信託差損益金	**19,030,409,912**
(配当等相当額)	(20,954,454,292)
(売買損益相当額)	(△1,924,044,380)
(G) 計 (D+E+F)	**29,954,514,869**
(H) 収益分配金	**0**
次期繰越損益金(G+H)	**29,954,514,869**
追加信託差損益金	19,030,409,912
(配当等相当額)	(20,965,555,517)
(売買損益相当額)	(△1,935,145,605)
分配準備積立金	10,924,104,957

(注1)(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3)(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は20,257,157,355円、期中追加設定元本額は2,782,592,255円、期中一部解約元本額は3,118,399,825円です。
※分配金の計算過程

項　　目	当　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	1,220,837,112円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	1,830,236,292円
(C) 収益調整金額	20,965,555,517円
(D) 分配準備積立金額	7,873,031,553円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	31,889,660,474円
(F) 期末残存口数	19,921,349,785口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	16,007円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

「投資信託及び投資法人に関する法律」第14条の改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

（変更日：2025年4月1日）

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。
本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。
今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

外国債券マザーファンド

運 用 報 告 書

第24期（決算日　2025年2月7日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	信託期間は2001年2月22日から無期限です。
運　用　方　針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組　入　制　限	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10％以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】
・基準価額は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

＜880005＞

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第20期(2021年2月8日)	25,857	4.0	496.296	3.9	97.7	1.5	144,346
第21期(2022年2月7日)	26,350	1.9	505.817	1.9	97.9	1.4	150,121
第22期(2023年2月7日)	26,193	△0.6	503.924	△0.4	98.3	0.8	151,005
第23期(2024年2月7日)	29,751	13.6	571.679	13.4	98.4	0.5	175,654
第24期(2025年2月7日)	31,049	4.4	597.663	4.5	98.3	0.4	187,572

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2024年 2月7日	29,751	－	571.679	－	98.4	0.5
2月末	30,207	1.5	580.855	1.6	98.0	0.5
3月末	30,584	2.8	587.851	2.8	98.3	0.7
4月末	31,164	4.7	597.531	4.5	98.2	0.6
5月末	31,334	5.3	601.573	5.2	98.0	0.5
6月末	32,420	9.0	621.561	8.7	97.7	0.9
7月末	31,246	5.0	608.326	6.4	98.1	0.6
8月末	30,448	2.3	586.818	2.6	97.6	0.9
9月末	30,519	2.6	586.361	2.6	96.8	1.6
10月末	31,777	6.8	608.878	6.5	98.3	0.4
11月末	31,130	4.6	600.817	5.1	97.9	0.6
12月末	32,104	7.9	613.976	7.4	98.1	0.6
2025年 1月末	31,434	5.7	604.077	5.7	97.9	0.6
(当期末)						
2025年 2月7日	31,049	4.4	597.663	4.5	98.3	0.4

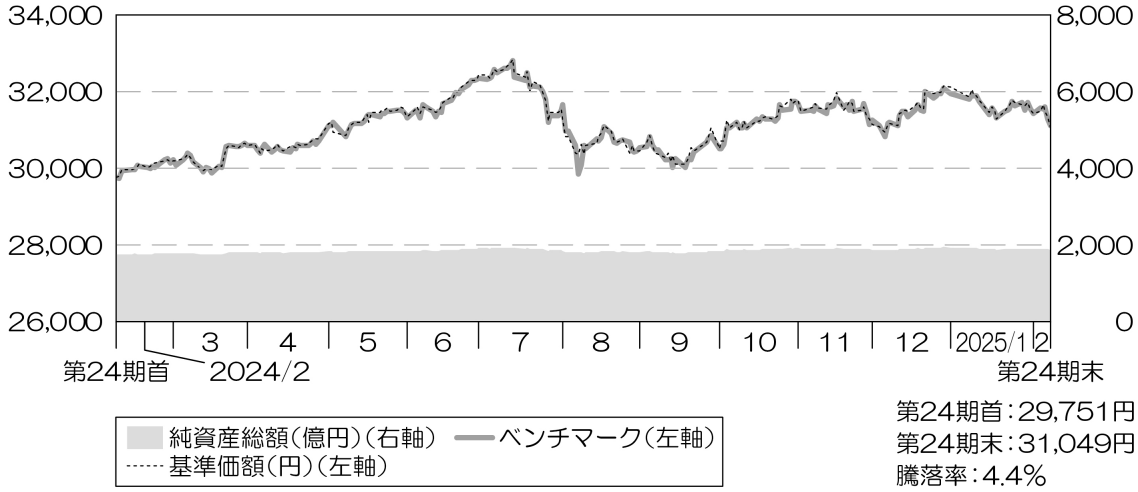
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。
【FTSE世界国債インデックス】は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



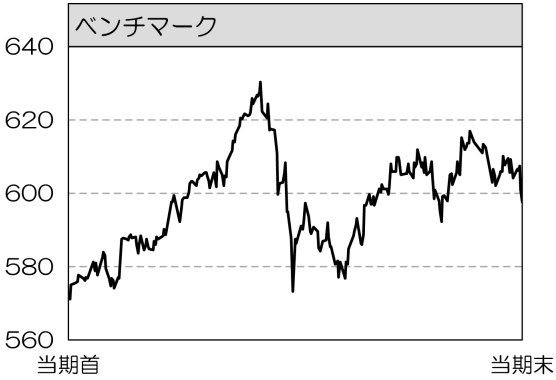
第24期首：29,751円
第24期末：31,049円
騰落率：4.4%

(注)ベンチマークは、2024年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

投資環境



外国債券市場では、2024年4月にかけては、雇用指標や物価指標をはじめとする米国の経済指標が上振れたことや、FRB(米連邦準備理事会)高官から早期利下げに否定的な発言が相次いだことなどを受けて早期の利下げ観測が後退し、主要国の長期金利は上昇(債券価格は下落)しました。その後2024年9月にかけては、軟調な米国の雇用指標や中東情勢の緊迫化によるリスク心理の悪化などを受けて主要国の長期金利は低下(債券価格は上昇)しましたが、期末にかけては米大統領選挙におけるトランプ氏の勝利が織り込まれる中で、米国のインフレ再燃や財政悪化が警戒され、主要国の長期金利は再び上昇しました。

外国為替市場では、2024年7月上旬にかけて、日本と主要国の金融政策の違いを背景に、主要通貨は対円で上昇しました。9月中旬にかけて、米国で利下げ観測が高まった一方、日銀が利上げを行ったことなどから、主要通貨は対円で下落しました。期末にかけて、堅調な米経済指標などを受けて、主要通貨は再び対円で上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1)債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分はヘッジ目的で債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

(2)ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

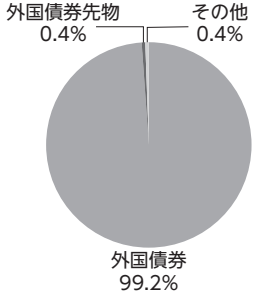
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

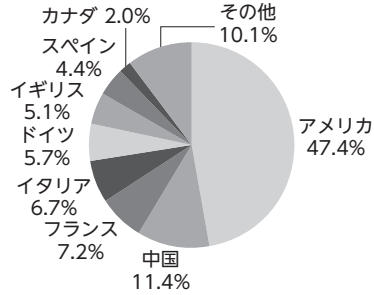
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 0.375% 01/31/26	アメリカ	0.8%
2	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.8%
3	T 4.125% 02/15/27	アメリカ	0.8%
4	T 4.125% 03/31/29	アメリカ	0.7%
5	T 4.375% 05/15/34	アメリカ	0.7%
6	T 4.25% 02/15/54	アメリカ	0.6%
7	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	0.6%
8	T 0.5% 05/31/27	アメリカ	0.6%
9	T 2% 11/15/26	アメリカ	0.6%
10	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		902	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

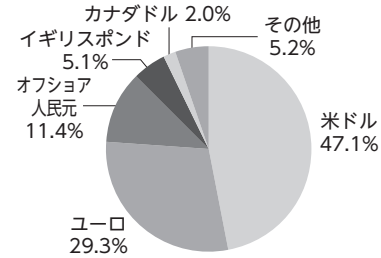
○資産別配分



○国別配分



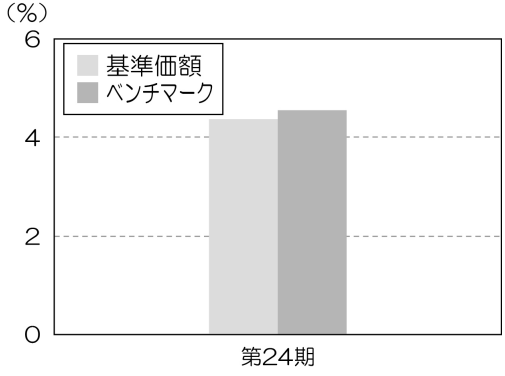
○通貨別配分



(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。
(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.4%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。
ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差(※)等です。

(※) 当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2024年2月8日～2025年2月7日) 金額	比率	項目の概要
(a)売買委託手数料	**0円**	**0.000%**	(a)売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b)有価証券取引税	**－**	**－**	(b)有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(c)その他費用	**6**	**0.019**	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(6)	(0.019)	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)	(－)	(－)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	**6**	**0.019**	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(31,197円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

〈公社債〉

			当期 買付額	当期 売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 152,690	千米ドル 132,082
	カナダ	国債証券	千カナダドル 11,270	千カナダドル 9,193
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 33,379	千メキシコペソ 10,156
	ドイツ	国債証券	千ユーロ 14,876	千ユーロ 16,926
	イタリア	国債証券	13,687	16,992
	フランス	国債証券	12,956	15,887
	オランダ	国債証券	1,565	3,043
	スペイン	国債証券	8,508	10,911
	ベルギー	国債証券	1,755	2,360
	オーストリア	国債証券	1,381	1,802
	フィンランド	国債証券	965	881
	アイルランド	国債証券	304	1,121
	ポルトガル	国債証券	6,904	31
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 12,837	千イギリスポンド 9,986
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 2,524	千スウェーデンクローナ 5,196
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 2,857	千ノルウェークローネ 3,385
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 1,517	千デンマーククローネ 4,654
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 8,626	千ポーランドズロチ 6,020
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 2,202	千オーストラリアドル 2,882
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 1,644	千ニュージーランドドル 478
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 765	千シンガポールドル 918
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 3,182	千マレーシアリンギット 3,506
	中国オフショア	国債証券	千オフショア人民元 503,193	千オフショア人民元 238,026
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 3,953	千イスラエルシェケル 2,460

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

〈先物取引の種類別取引状況〉

種類別		当期			
		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	債券先物取引	百万円 15,817	百万円 15,934	百万円 －	百万円 －

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	26,144	26,144	100.0	26,160	26,160	100.0
為替直物取引	14,579	14,542	99.7	10,518	10,434	99.2
金銭信託	11	11	100.0	11	11	100.0
コール・ローン	336,054	63,512	18.9	335,766	63,320	18.9

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細

〈外国(外貨建)公社債〉

(A)債券種類別開示

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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	645,930	577,485	87,373,523	46.6	－	19.7	17.5	9.5
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	36,070	35,189	3,719,215	2.0	－	1.1	0.5	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	213,800	194,343	1,437,850	0.8	－	0.4	0.3	0.1
	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	70,110	66,711	10,477,073	5.6	－	3.1	1.8	0.7
イタリア	79,930	78,743	12,366,650	6.6	－	3.8	1.8	0.9
フランス	92,260	84,735	13,307,721	7.1	－	4.1	2.2	0.8
オランダ	15,690	14,616	2,295,594	1.2	－	0.8	0.3	0.1
スペイン	53,310	51,539	8,094,248	4.3	－	2.5	1.2	0.6
ベルギー	19,560	18,301	2,874,218	1.5	－	1.0	0.4	0.1
オーストリア	13,960	12,715	1,997,007	1.1	－	0.7	0.3	0.1
フィンランド	6,470	5,811	912,706	0.5	－	0.3	0.1	0.0
アイルランド	6,080	5,517	866,511	0.5	－	0.3	0.1	0.0
ポルトガル	7,120	6,865	1,078,207	0.6	－	0.4	0.2	0.0
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	60,420	50,002	9,401,057	5.0	－	3.6	1.1	0.3
	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
スウェーデン	22,890	22,417	311,374	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	22,690	21,159	285,868	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	20,080	19,412	408,634	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	29,990	27,551	1,032,576	0.6	－	0.2	0.3	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	26,220	23,661	2,249,227	1.2	－	0.8	0.3	0.1
	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル						
ニュージーランド	6,410	5,866	503,840	0.3	－	0.2	0.1	0.0
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	6,520	6,372	713,955	0.4	－	0.2	0.1	0.1
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	26,650	27,442	936,496	0.5	－	0.3	0.1	0.0
	千オフショア人民元	千オフショア人民元						
中国オフショア	944,460	1,013,863	21,045,681	11.2	－	5.1	4.1	2.0
	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル						
イスラエル	17,080	15,630	665,582	0.4	－	0.2	0.1	0.0
合計	－	－	184,354,824	98.3	－	49.0	33.1	16.2

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3)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) 個別銘柄開示

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 0.375% 01/31/26	0.375	10,690	10,295	1,557,677	2026/1/31
T 0.375% 07/31/27	0.375	4,000	3,641	550,968	2027/7/31
T 0.375% 09/30/27	0.375	4,000	3,619	547,611	2027/9/30
T 0.5% 02/28/26	0.5	3,500	3,365	509,155	2026/2/28
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,000	1,843	278,947	2027/4/30
T 0.5% 05/31/27	0.5	8,100	7,443	1,126,195	2027/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	2,500	2,290	346,571	2027/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	1,100	1,001	151,555	2027/8/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	6,750	6,107	924,134	2027/10/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	3,400	3,152	477,014	2027/3/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	7,400	6,129	927,360	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	4,000	3,795	574,325	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	9,130	7,493	1,133,747	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	3,700	3,350	506,890	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	3,000	2,708	409,724	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	3,500	3,161	478,394	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	2,750	2,643	400,008	2026/3/31
T 0.75% 04/30/26	0.75	3,500	3,355	507,654	2026/4/30
T 0.75% 08/31/26	0.75	3,000	2,843	430,283	2026/8/31
T 0.875% 09/30/26	0.875	5,000	4,736	716,695	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	6,160	5,092	770,508	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	2,500	2,239	338,880	2028/7/31
T 1.125% 02/15/31	1.125	3,890	3,241	490,456	2031/2/15
T 1.125% 02/29/28	1.125	3,880	3,537	535,219	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,550	959	145,211	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	3,600	2,208	334,201	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	4,000	3,589	543,155	2028/8/31
T 1.125% 10/31/26	1.125	6,850	6,500	983,471	2026/10/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	4,100	3,743	566,354	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	5,300	4,825	730,111	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	5,120	2,508	379,551	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	6,000	5,450	824,661	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	1,000	906	137,094	2028/6/30
T 1.25% 08/15/31	1.25	6,550	5,406	818,013	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	3,800	3,417	517,008	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	3,000	2,846	430,673	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	5,500	5,206	787,698	2026/12/31
T 1.375% 08/15/50	1.375	2,300	1,158	175,259	2050/8/15
T 1.375% 08/31/26	1.375	2,090	2,001	302,796	2026/8/31
T 1.375% 10/31/28	1.375	1,700	1,532	231,855	2028/10/31
T 1.375% 11/15/31	1.375	12,110	10,006	1,513,962	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	4,350	2,768	418,853	2040/11/15
T 1.5% 01/31/27	1.5	4,850	4,602	696,283	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	1,820	1,592	241,015	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	5,300	5,089	770,049	2026/8/15
T 1.5% 11/30/28	1.5	5,550	5,014	758,744	2028/11/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	4,450	4,333	655,678	2026/2/15
T 1.625% 05/15/26	1.625	5,400	5,227	790,881	2026/5/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	4,290	3,656	553,262	2031/5/15
T 1.625% 08/15/29	1.625	1,760	1,572	237,890	2029/8/15
T 1.625% 09/30/26	1.625	2,150	2,062	312,111	2026/9/30
T 1.625% 11/15/50	1.625	3,100	1,667	252,341	2050/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	3,030	2,895	438,015	2026/11/30
T 1.75% 01/31/29	1.75	2,500	2,271	343,675	2029/1/31
T 1.75% 08/15/41	1.75	4,800	3,196	483,573	2041/8/15
T 1.75% 11/15/29	1.75	2,220	1,983	300,093	2029/11/15
T 1.75% 12/31/26	1.75	4,300	4,110	621,936	2026/12/31
T 1.875% 02/15/32	1.875	6,200	5,272	797,754	2032/2/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	4,750	3,269	494,748	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	4,500	2,580	390,504	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	3,000	2,862	433,137	2027/2/28
T 1.875% 02/28/29	1.875	5,950	5,423	820,585	2029/2/28
T 1.875% 06/30/26	1.875	3,980	3,855	583,273	2026/6/30
T 1.875% 07/31/26	1.875	1,800	1,740	263,292	2026/7/31
T 1.875% 11/15/51	1.875	3,400	1,933	292,576	2051/11/15
T 2% 02/15/50	2.0	3,370	2,017	305,191	2050/2/15
T 2% 08/15/51	2.0	6,090	3,586	542,628	2051/8/15
T 2% 11/15/26	2.0	7,450	7,170	1,084,959	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	4,140	2,858	432,423	2041/11/15
T 2.25% 02/15/27	2.25	3,900	3,752	567,827	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	2,410	1,503	227,553	2052/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	1,500	1,467	221,976	2026/3/31
T 2.25% 05/15/41	2.25	1,600	1,165	176,325	2041/5/15
T 2.25% 08/15/27	2.25	1,820	1,735	262,544	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	2,180	1,449	219,262	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	2,110	1,346	203,691	2049/8/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	5,260	4,991	755,144	2027/11/15
T 2.375% 02/15/42	2.375	1,350	986	149,217	2042/2/15
T 2.375% 03/31/29	2.375	5,400	5,013	758,520	2029/3/31
T 2.375% 04/30/26	2.375	1,820	1,779	269,288	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	3,600	3,457	523,116	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	6,390	5,921	895,977	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	1,980	1,281	193,822	2051/5/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	2,010	1,315	199,045	2049/11/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	1,750	1,246	188,579	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	1,250	879	132,993	2046/2/15
T 2.5% 02/28/26	2.5	650	638	96,575	2026/2/28
T 2.5% 05/15/46	2.5	1,810	1,267	191,804	2046/5/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	1,350	1,329	201,103	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	6,900	6,483	980,985	2029/2/15
T 2.625% 05/31/27	2.625	2,900	2,799	423,533	2027/5/31
T 2.625% 07/31/29	2.625	4,000	3,733	564,821	2029/7/31
T 2.75% 02/15/28	2.75	4,670	4,474	677,024	2028/2/15
T 2.75% 04/30/27	2.75	5,500	5,330	806,535	2027/4/30
T 2.75% 05/31/29	2.75	6,000	5,642	853,757	2029/5/31
T 2.75% 07/31/27	2.75	5,000	4,828	730,569	2027/7/31
T 2.75% 08/15/32	2.75	3,180	2,850	431,338	2032/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	2,330	1,794	271,502	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	300	216	32,831	2047/8/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	1,650	1,264	191,348	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	1,400	1,010	152,866	2047/11/15
T 2.875% 04/30/29	2.875	4,170	3,945	597,008	2029/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	4,460	4,274	646,791	2028/5/15
T 2.875% 05/15/32	2.875	6,750	6,126	926,926	2032/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	1,350	1,048	158,584	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	1,410	1,028	155,558	2049/5/15
T 2.875% 05/15/52	2.875	2,700	1,938	293,345	2052/5/15
T 2.875% 08/15/28	2.875	5,590	5,340	808,054	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	1,880	1,423	215,388	2045/8/15
T 3% 02/15/47	3.0	1,500	1,142	172,854	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	2,950	2,225	336,730	2048/2/15

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 3% 02/15/49	3.0	1,940	1,451	219,659	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,100	883	133,677	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	600	465	70,361	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	1,300	987	149,442	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	2,360	1,772	268,240	2048/8/15
T 3% 08/15/52	3.0	2,570	1,894	286,595	2052/8/15
T 3% 11/15/44	3.0	1,550	1,207	182,656	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,000	821	124,249	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	3,600	2,913	440,765	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	1,400	1,078	163,134	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	1,550	1,234	186,796	2044/8/15
T 3.125% 08/31/29	3.125	4,300	4,095	619,712	2029/8/31
T 3.125% 11/15/28	3.125	6,160	5,917	895,291	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	870	716	108,451	2041/11/15
T 3.25% 05/15/42	3.25	1,500	1,249	189,037	2042/5/15
T 3.25% 06/30/27	3.25	1,850	1,810	273,907	2027/6/30
T 3.375% 05/15/33	3.375	2,310	2,146	324,785	2033/5/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	1,800	1,495	226,254	2044/5/15
T 3.375% 08/15/42	3.375	1,200	1,014	153,538	2042/8/15
T 3.375% 09/15/27	3.375	1,660	1,625	245,958	2027/9/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	2,100	1,686	255,102	2048/11/15
T 3.5% 01/31/30	3.5	5,040	4,862	735,758	2030/1/31
T 3.5% 02/15/33	3.5	6,000	5,639	853,296	2033/2/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	200	179	27,109	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,300	1,988	300,793	2044/2/15
T 3.625% 02/15/53	3.625	3,270	2,728	412,807	2053/2/15
T 3.625% 05/15/53	3.625	1,650	1,376	208,336	2053/5/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,700	2,342	354,462	2043/8/15
T 3.625% 08/31/29	3.625	3,200	3,114	471,261	2029/8/31
T 3.75% 04/15/26	3.75	5,800	5,766	872,535	2026/4/15
T 3.75% 06/30/30	3.75	2,500	2,433	368,173	2030/6/30
T 3.75% 08/15/41	3.75	1,100	989	149,689	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	1,800	1,586	240,084	2043/11/15
T 3.875% 02/15/43	3.875	830	749	113,379	2043/2/15
T 3.875% 08/15/33	3.875	5,900	5,677	859,037	2033/8/15
T 3.875% 08/15/34	3.875	2,000	1,913	289,526	2034/8/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	680	625	94,659	2040/8/15
T 3.875% 09/30/29	3.875	1,550	1,523	230,493	2029/9/30
T 3.875% 11/30/29	3.875	3,880	3,810	576,518	2029/11/30
T 3.875% 12/31/29	3.875	1,500	1,472	222,818	2029/12/31
T 4% 02/15/34	4.0	6,400	6,198	937,814	2034/2/15
T 4% 02/28/30	4.0	2,400	2,368	358,318	2030/2/28
T 4% 02/29/28	4.0	2,200	2,185	330,610	2028/2/29
T 4% 06/30/28	4.0	2,000	1,985	300,336	2028/6/30
T 4% 07/31/30	4.0	800	788	119,236	2030/7/31
T 4% 11/15/52	4.0	3,500	3,124	472,726	2052/11/15
T 4.125% 02/15/27	4.125	9,800	9,783	1,480,191	2027/2/15
T 4.125% 03/31/29	4.125	9,000	8,948	1,353,907	2029/3/31
T 4.125% 03/31/31	4.125	3,560	3,519	532,536	2031/3/31
T 4.125% 07/31/31	4.125	2,150	2,123	321,260	2031/7/31
T 4.125% 08/15/44	4.125	350	324	49,057	2044/8/15
T 4.125% 08/15/53	4.125	3,300	3,014	456,089	2053/8/15
T 4.125% 08/31/30	4.125	3,400	3,367	509,557	2030/8/31
T 4.125% 10/31/31	4.125	2,200	2,170	328,445	2031/10/31
T 4.125% 11/15/32	4.125	5,690	5,600	847,378	2032/11/15
T 4.25% 01/31/26	4.25	1,300	1,299	196,681	2026/1/31
T 4.25% 02/15/54	4.25	7,900	7,379	1,116,550	2054/2/15

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 4.25% 05/15/39	4.25	850	823	124,616	2039/5/15
T 4.25% 08/15/54	4.25	1,000	935	141,536	2054/8/15
T 4.25% 11/15/34	4.25	1,700	1,674	253,371	2034/11/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	650	624	94,422	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	500	495	74,896	2038/2/15
T 4.375% 05/15/34	4.375	8,600	8,563	1,295,690	2034/5/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	750	732	110,808	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	550	534	80,936	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	650	636	96,339	2039/11/15
T 4.375% 11/30/30	4.375	3,970	3,980	602,279	2030/11/30
T 4.5% 02/15/36	4.5	210	212	32,218	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	250	250	37,916	2038/5/15
T 4.5% 07/15/26	4.5	4,000	4,015	607,540	2026/7/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	750	745	112,783	2039/8/15
T 4.5% 11/15/33	4.5	6,250	6,288	951,424	2033/11/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	700	703	106,414	2040/2/15
T 4.625% 03/15/26	4.625	2,170	2,178	329,661	2026/3/15
T 4.625% 04/30/31	4.625	2,000	2,030	307,280	2031/4/30
T 4.625% 05/15/44	4.625	390	386	58,490	2044/5/15
T 4.625% 05/15/54	4.625	1,150	1,144	173,097	2054/5/15
T 4.625% 09/30/28	4.625	2,950	2,986	451,861	2028/9/30
T 4.625% 10/15/26	4.625	5,800	5,837	883,178	2026/10/15
T 4.625% 11/15/26	4.625	3,600	3,624	548,371	2026/11/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	762	115,314	2041/2/15
T 4.75% 11/15/43	4.75	1,100	1,110	168,029	2043/11/15
T 4.75% 11/15/53	4.75	2,500	2,532	383,199	2053/11/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	300	315	47,804	2037/5/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,900	1,964	297,228	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	750	791	119,756	2031/2/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	600	610	92,417	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,850	1,943	294,053	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	2,920	3,187	482,247	2030/5/15
小計				87,373,523	
（カナダ）		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	1,130	1,101	116,455	2026/3/1
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	1,570	1,384	146,302	2030/12/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	640	618	65,359	2027/6/1
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,060	1,035	109,397	2026/9/1
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	1,440	1,402	148,232	2027/3/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	1,770	1,644	173,825	2030/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	740	729	77,152	2026/6/1
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	2,010	1,863	196,913	2031/6/1
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	1,230	1,130	119,523	2031/12/1
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	1,520	1,120	118,423	2053/12/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	420	412	43,631	2028/6/1
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,060	1,001	105,896	2032/6/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	2,330	1,845	195,100	2051/12/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	390	385	40,722	2029/6/1
CAN 2.25% 12/01/29	2.25	240	235	24,932	2029/12/1
CAN 2.5% 12/01/32	2.5	980	955	100,978	2032/12/1
CAN 2.75% 06/01/33	2.75	330	326	34,542	2033/6/1
CAN 2.75% 09/01/27	2.75	710	713	75,382	2027/9/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	520	486	51,409	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/55	2.75	920	847	89,566	2055/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	350	325	34,454	2064/12/1
CAN 3% 04/01/26	3.0	970	973	102,913	2026/4/1

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
CAN 3% 06/01/34	3.0	1,160	1,165	123,206	2034/6/1
CAN 3.25% 06/01/35	3.25	300	306	32,435	2035/6/1
CAN 3.25% 09/01/28	3.25	1,010	1,032	109,144	2028/9/1
CAN 3.25% 12/01/33	3.25	600	615	65,090	2033/12/1
CAN 3.25% 12/01/34	3.25	1,010	1,034	109,381	2034/12/1
CAN 3.5% 03/01/28	3.5	780	801	84,672	2028/3/1
CAN 3.5% 09/01/29	3.5	1,180	1,223	129,328	2029/9/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	490	518	54,820	2045/12/1
CAN 4% 03/01/29	4.0	1,000	1,053	111,336	2029/3/1
CAN 4% 05/01/26	4.0	1,530	1,554	164,337	2026/5/1
CAN 4% 08/01/26	4.0	1,180	1,203	127,212	2026/8/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	420	468	49,554	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	230	276	29,248	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	680	768	81,214	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	2,170	2,621	277,115	2033/6/1
小計				3,719,215	
（メキシコ）		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10% 11/20/36	10.0	4,750	4,850	35,884	2036/11/20
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	15,140	14,092	104,266	2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	28,180	27,221	201,394	2026/3/5
MBONO 7% 09/03/26	7.0	3,040	2,947	21,807	2026/9/3
MBONO 7.5% 05/26/33	7.5	14,930	13,095	96,885	2033/5/26
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	20,520	19,790	146,422	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	22,210	20,347	150,543	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	15,680	12,553	92,877	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	12,210	10,690	79,095	2034/11/23
MBONO 8% 07/31/53	8.0	14,920	11,888	87,958	2053/7/31
MBONO 8% 11/07/47	8.0	14,310	11,547	85,430	2047/11/7
MBONO 8.5% 03/01/29	8.5	18,250	17,677	130,788	2029/3/1
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	15,940	15,402	113,952	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	13,720	12,238	90,543	2038/11/18
小計				1,437,850	
（ドイツ）		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
BKO 2.5% 03/19/26	2.5	1,070	1,074	168,724	2026/3/19
BKO 2.7% 09/17/26	2.7	1,660	1,676	263,258	2026/9/17
DBR 0% 02/15/30	－	1,150	1,036	162,813	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	－	1,380	1,216	191,040	2031/2/15
DBR 0% 02/15/32	－	1,680	1,443	226,666	2032/2/15
DBR 0% 05/15/35	－	1,180	925	145,393	2035/5/15
DBR 0% 05/15/36	－	1,320	1,005	157,858	2036/5/15
DBR 0% 08/15/26	－	1,950	1,892	297,159	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	－	1,030	939	147,547	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	－	1,880	1,676	263,336	2030/8/15
DBR 0% 08/15/30	－	400	356	56,039	2030/8/15
DBR 0% 08/15/31	－	1,860	1,619	254,323	2031/8/15
DBR 0% 08/15/50	－	2,530	1,329	208,782	2050/8/15
DBR 0% 08/15/52	－	1,560	780	122,602	2052/8/15
DBR 0% 11/15/27	－	1,230	1,164	182,808	2027/11/15
DBR 0% 11/15/28	－	1,250	1,159	182,100	2028/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	950	917	144,105	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	1,750	1,630	256,086	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	1,300	1,223	192,137	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	1,330	1,309	205,604	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	110	105	16,522	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	580	559	87,815	2027/8/15

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DBR 1% 05/15/38	1.0	970	803	126,245	2038/5/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	1,760	1,350	212,151	2048/8/15
DBR 1.7% 08/15/32	1.7	1,310	1,263	198,467	2032/8/15
DBR 1.8% 08/15/53	1.8	1,630	1,372	215,562	2053/8/15
DBR 1.8% 08/15/53	1.8	290	244	38,412	2053/8/15
DBR 2.1% 11/15/29	2.1	1,280	1,278	200,722	2029/11/15
DBR 2.2% 02/15/34	2.2	1,600	1,585	248,930	2034/2/15
DBR 2.3% 02/15/33	2.3	2,120	2,126	333,933	2033/2/15
DBR 2.4% 11/15/30	2.4	1,370	1,387	217,843	2030/11/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	1,520	1,497	235,165	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,500	1,476	231,945	2046/8/15
DBR 2.5% 08/15/54	2.5	1,000	979	153,845	2054/8/15
DBR 2.6% 05/15/41	2.6	240	239	37,667	2041/5/15
DBR 2.6% 08/15/33	2.6	1,410	1,443	226,712	2033/8/15
DBR 2.6% 08/15/34	2.6	1,430	1,461	229,465	2034/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	930	1,014	159,252	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	1,400	1,617	254,041	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	990	1,189	186,785	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,180	1,284	201,723	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	1,160	1,396	219,309	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,100	1,401	220,067	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	1,090	1,289	202,477	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,500	1,649	259,109	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	610	724	113,860	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,270	1,401	220,077	2027/7/4
OBL 0% 04/10/26	－	1,500	1,464	230,050	2026/4/10
OBL 0% 04/16/27	－	440	421	66,172	2027/4/16
OBL 0% 10/09/26	－	1,360	1,315	206,627	2026/10/9
OBL 1.3% 10/15/27	1.3	1,820	1,787	280,658	2027/10/15
OBL 2.1% 04/12/29	2.1	1,630	1,629	255,932	2029/4/12
OBL 2.1% 04/12/29	2.1	690	689	108,359	2029/4/12
OBL 2.2% 04/13/28	2.2	1,400	1,406	220,876	2028/4/13
OBL 2.4% 10/19/28	2.4	1,460	1,476	231,890	2028/10/19
（イタリア）					
国債証券					
BTPS 0% 04/01/26	－	2,700	2,633	413,542	2026/4/1
BTPS 0% 08/01/26	－	490	474	74,523	2026/8/1
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,250	1,169	183,622	2028/3/15
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	1,210	1,112	174,732	2029/2/15
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,250	1,228	192,995	2026/2/1
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	730	682	107,262	2028/7/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	1,300	1,120	175,967	2031/8/1
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	1,920	1,870	293,691	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	1,300	1,152	180,942	2031/4/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	850	636	99,975	2037/3/1
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	1,190	1,026	161,214	2032/6/1
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	420	380	59,701	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	1,000	965	151,579	2027/9/15
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	1,120	979	153,757	2031/12/1
BTPS 1.1% 04/01/27	1.1	900	877	137,853	2027/4/1
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,170	1,150	180,636	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,510	1,408	221,142	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	830	677	106,416	2036/3/1
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	650	442	69,467	2045/4/30
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,350	1,339	210,390	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	1,300	1,187	186,428	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	820	765	120,285	2030/12/1

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	750	486	76,407	2051/9/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	890	680	106,910	2041/3/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	750	741	116,449	2028/2/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	1,040	1,033	162,311	2027/8/1
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	360	232	36,553	2072/3/1
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	660	467	73,344	2052/9/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	1,110	1,107	174,005	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,190	1,051	165,150	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	1,360	1,284	201,778	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	970	744	116,924	2050/9/1
BTPS 2.5% 12/01/32	2.5	1,080	1,033	162,360	2032/12/1
BTPS 2.65% 12/01/27	2.65	770	775	121,757	2027/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	900	746	117,200	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	500	387	60,903	2067/3/1
BTPS 2.8% 06/15/29	2.8	700	704	110,616	2029/6/15
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,260	1,272	199,920	2028/12/1
BTPS 2.95% 02/15/27	2.95	950	961	151,025	2027/2/15
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	850	789	123,980	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	670	680	106,804	2029/8/1
BTPS 3% 10/01/29	3.0	340	343	53,985	2029/10/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	590	547	86,019	2040/3/1
BTPS 3.1% 08/28/26	3.1	830	839	131,903	2026/8/28
BTPS 3.25% 03/01/38	3.25	570	548	86,063	2038/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	880	800	125,758	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,390	1,387	217,867	2035/3/1
BTPS 3.35% 07/01/29	3.35	1,420	1,457	228,947	2029/7/1
BTPS 3.4% 04/01/28	3.4	1,050	1,078	169,452	2028/4/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	890	830	130,356	2048/3/1
BTPS 3.45% 07/15/31	3.45	760	779	122,367	2031/7/15
BTPS 3.5% 02/15/31	3.5	790	813	127,723	2031/2/15
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	1,140	1,182	185,688	2030/3/1
BTPS 3.7% 06/15/30	3.7	950	989	155,443	2030/6/15
BTPS 3.8% 08/01/28	3.8	690	718	112,884	2028/8/1
BTPS 3.85% 02/01/35	3.85	340	352	55,386	2035/2/1
BTPS 3.85% 07/01/34	3.85	750	780	122,574	2034/7/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	840	830	130,353	2049/9/1
BTPS 3.85% 12/15/29	3.85	1,250	1,312	206,140	2029/12/15
BTPS 4% 02/01/37	4.0	1,200	1,260	197,917	2037/2/1
BTPS 4% 04/30/35	4.0	620	655	102,960	2035/4/30
BTPS 4% 10/30/31	4.0	440	468	73,503	2031/10/30
BTPS 4% 11/15/30	4.0	1,490	1,575	247,390	2030/11/15
BTPS 4.05% 10/30/37	4.05	600	630	98,954	2037/10/30
BTPS 4.1% 04/30/46	4.1	140	144	22,725	2046/4/30
BTPS 4.15% 10/01/39	4.15	730	763	119,985	2039/10/1
BTPS 4.2% 03/01/34	4.2	900	963	151,276	2034/3/1
BTPS 4.3% 10/01/54	4.3	350	364	57,255	2054/10/1
BTPS 4.35% 11/01/33	4.35	1,140	1,234	193,836	2033/11/1
BTPS 4.4% 05/01/33	4.4	240	260	40,983	2033/5/1
BTPS 4.45% 09/01/43	4.45	640	687	108,042	2043/9/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	930	951	149,383	2026/3/1
BTPS 4.5% 10/01/53	4.5	570	616	96,835	2053/10/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	1,260	1,355	212,922	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	930	1,042	163,780	2044/9/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	1,020	1,158	181,980	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	1,220	1,395	219,213	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	1,390	1,591	249,926	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	1,770	1,973	309,898	2029/11/1

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	1,760	2,076	326,189	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	1,320	1,552	243,846	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	1,430	1,584	248,783	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	350	379	59,603	2026/11/1
（フランス）					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/26	－	2,790	2,727	428,390	2026/2/25
FRTR 0% 02/25/27	－	2,140	2,045	321,194	2027/2/25
FRTR 0% 05/25/32	－	1,850	1,508	236,879	2032/5/25
FRTR 0% 11/25/29	－	2,460	2,178	342,145	2029/11/25
FRTR 0% 11/25/30	－	3,230	2,773	435,526	2030/11/25
FRTR 0% 11/25/31	－	3,590	2,980	468,120	2031/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	1,800	1,738	273,092	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	1,800	1,761	276,718	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	1,600	1,469	230,752	2029/5/25
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	1,460	965	151,685	2040/5/25
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	640	226	35,550	2072/5/25
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	1,100	652	102,450	2044/6/25
FRTR 0.75% 02/25/28	0.75	3,520	3,353	526,693	2028/2/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	2,910	2,759	433,358	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	1,930	1,002	157,442	2052/5/25
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	1,750	887	139,311	2053/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	2,690	2,524	396,425	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	2,850	2,770	435,094	2027/5/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	2,500	2,144	336,803	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	2,320	1,901	298,674	2036/5/25
FRTR 1.25% 05/25/38	1.25	1,310	1,024	160,866	2038/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	2,940	2,734	429,530	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	1,950	1,293	203,179	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	850	527	82,878	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	1,660	1,370	215,163	2039/6/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	1,580	1,206	189,404	2048/5/25
FRTR 2% 11/25/32	2.0	1,590	1,491	234,289	2032/11/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	2,720	2,704	424,704	2030/5/25
FRTR 2.5% 05/25/43	2.5	910	793	124,690	2043/5/25
FRTR 2.5% 09/24/26	2.5	1,670	1,677	263,486	2026/9/24
FRTR 2.5% 09/24/27	2.5	1,280	1,285	201,924	2027/9/24
FRTR 2.75% 02/25/29	2.75	2,210	2,229	350,217	2029/2/25
FRTR 2.75% 02/25/30	2.75	370	372	58,453	2030/2/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	3,080	3,114	489,156	2027/10/25
FRTR 3% 05/25/33	3.0	2,110	2,117	332,567	2033/5/25
FRTR 3% 05/25/54	3.0	1,070	951	149,428	2054/5/25
FRTR 3% 11/25/34	3.0	2,270	2,254	354,101	2034/11/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	1,800	1,746	274,227	2045/5/25
FRTR 3.25% 05/25/55	3.25	550	510	80,209	2055/5/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	1,400	1,421	223,232	2026/4/25
FRTR 3.5% 11/25/33	3.5	2,130	2,211	347,348	2033/11/25
FRTR 3.6% 05/25/42	3.6	650	663	104,252	2042/5/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	980	1,047	164,436	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,020	1,091	171,468	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	1,150	1,239	194,605	2038/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	1,840	2,094	328,863	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	1,590	1,817	285,474	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	2,500	2,794	438,836	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	2,150	2,575	404,409	2032/10/25

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（オランダ）	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
NETHER 0% 01/15/27	－	570	547	86,028	2027/1/15
NETHER 0% 01/15/29	－	1,040	954	149,869	2029/1/15
NETHER 0% 01/15/38	－	530	374	58,828	2038/1/15
NETHER 0% 01/15/52	－	970	481	75,543	2052/1/15
NETHER 0% 07/15/30	－	850	751	118,018	2030/7/15
NETHER 0% 07/15/31	－	650	559	87,934	2031/7/15
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	540	495	77,771	2029/7/15
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	780	569	89,410	2040/1/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	820	801	125,943	2026/7/15
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	560	487	76,587	2032/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	900	871	136,845	2027/7/15
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	510	486	76,361	2028/7/15
NETHER 2% 01/15/54	2.0	700	601	94,441	2054/1/15
NETHER 2.5% 01/15/30	2.5	420	424	66,615	2030/1/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	800	802	126,041	2033/1/15
NETHER 2.5% 07/15/33	2.5	590	590	92,698	2033/7/15
NETHER 2.5% 07/15/34	2.5	520	517	81,302	2034/7/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	960	964	151,428	2047/1/15
NETHER 3.25% 01/15/44	3.25	240	257	40,448	2044/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,010	1,145	179,926	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	950	1,079	169,500	2037/1/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	780	853	134,046	2028/1/15
（スペイン）					
国債証券					
SPGB 0% 01/31/26	－	1,070	1,046	164,427	2026/1/31
SPGB 0% 01/31/27	－	1,080	1,034	162,497	2027/1/31
SPGB 0% 01/31/28	－	1,280	1,195	187,819	2028/1/31
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	1,450	1,242	195,111	2031/4/30
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	1,600	1,443	226,687	2030/4/30
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	1,180	1,024	160,868	2031/10/31
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	970	889	139,680	2029/10/31
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	930	808	126,955	2032/4/30
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	1,190	1,148	180,408	2027/7/30
SPGB 0.8% 07/30/29	0.8	880	818	128,529	2029/7/30
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	750	570	89,526	2037/7/30
SPGB 1% 07/30/42	1.0	690	473	74,428	2042/7/30
SPGB 1% 10/31/50	1.0	1,130	654	102,756	2050/10/31
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	950	700	109,986	2040/10/31
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	1,200	1,115	175,220	2030/10/31
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	1,320	1,301	204,390	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	1,050	1,020	160,278	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	1,270	1,230	193,203	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	1,810	1,740	273,308	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	1,330	1,301	204,438	2027/10/31
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	260	135	21,230	2071/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,290	1,271	199,653	2027/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	1,190	1,065	167,358	2035/7/30
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	1,050	742	116,597	2052/10/31
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	1,790	1,784	280,315	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,520	1,474	231,593	2030/7/30
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	1,160	1,117	175,452	2033/7/30
SPGB 2.5% 05/31/27	2.5	470	472	74,219	2027/5/31
SPGB 2.55% 10/31/32	2.55	1,330	1,309	205,614	2032/10/31
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	890	773	121,546	2048/10/31
SPGB 2.8% 05/31/26	2.8	330	332	52,206	2026/5/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,020	930	146,092	2046/10/31
SPGB 3.15% 04/30/33	3.15	1,580	1,616	253,888	2033/4/30
SPGB 3.15% 04/30/35	3.15	920	930	146,058	2035/4/30
SPGB 3.25% 04/30/34	3.25	1,130	1,158	181,886	2034/4/30
SPGB 3.45% 07/30/43	3.45	760	756	118,730	2043/7/30
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	840	797	125,285	2066/7/30
SPGB 3.45% 10/31/34	3.45	830	862	135,455	2034/10/31
SPGB 3.5% 05/31/29	3.5	510	531	83,471	2029/5/31
SPGB 3.55% 10/31/33	3.55	1,330	1,396	219,357	2033/10/31
SPGB 3.9% 07/30/39	3.9	730	777	122,137	2039/7/30
SPGB 4% 10/31/54	4.0	320	339	53,343	2054/10/31
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,050	1,160	182,255	2037/1/31
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	920	1,071	168,305	2041/7/30
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,080	1,279	200,987	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	550	603	94,773	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	790	978	153,648	2044/10/31
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	950	1,142	179,379	2032/7/30
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,360	1,432	224,924	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	2,230	2,533	397,951	2029/1/31
（ベルギー）					
国債証券					
BGB 0% 10/22/27	－	530	499	78,416	2027/10/22
BGB 0% 10/22/31	－	520	437	68,747	2031/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	660	582	91,422	2030/6/22
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	860	727	114,201	2032/6/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	400	264	41,577	2040/6/22
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	340	139	21,971	2071/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	640	619	97,291	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	810	771	121,105	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,100	1,032	162,230	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	1,000	984	154,647	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	910	826	129,851	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	180	161	25,307	2033/4/22
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	520	330	51,948	2053/6/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	400	334	52,495	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	610	442	69,544	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	610	434	68,207	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	480	417	65,502	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	420	306	48,075	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	330	251	39,492	2057/6/22
BGB 2.7% 10/22/29	2.7	210	212	33,380	2029/10/22
BGB 2.75% 04/22/39	2.75	140	133	21,036	2039/4/22
BGB 2.85% 10/22/34	2.85	620	618	97,128	2034/10/22
BGB 3% 06/22/33	3.0	1,120	1,139	178,930	2033/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	310	314	49,367	2034/6/22
BGB 3.1% 06/22/35	3.1	300	304	47,791	2035/6/22
BGB 3.3% 06/22/54	3.3	580	561	88,165	2054/6/22
BGB 3.45% 06/22/43	3.45	280	285	44,832	2043/6/22
BGB 3.5% 06/22/55	3.5	270	269	42,382	2055/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	450	477	74,959	2045/6/22
BGB 4% 03/28/32	4.0	430	467	73,366	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	870	978	153,727	2041/3/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	510	523	82,140	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,110	1,311	206,007	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	1,040	1,139	178,961	2028/3/28
（オーストリア）					
国債証券					
RAGB 0% 02/20/30	－	680	603	94,711	2030/2/20

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
RAGB 0% 02/20/31	－	850	731	114,932	2031/2/20
RAGB 0% 10/20/28	－	420	386	60,689	2028/10/20
RAGB 0% 10/20/40	－	330	208	32,714	2040/10/20
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	360	266	41,887	2036/10/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	810	753	118,372	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	650	626	98,444	2027/4/20
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	280	128	20,160	2071/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	590	564	88,669	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	550	328	51,563	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	880	859	134,954	2026/10/20
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	200	86	13,595	2120/6/30
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	720	642	100,976	2032/2/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	560	425	66,809	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	200	122	19,246	2086/11/2
RAGB 1.85% 05/23/49	1.85	310	249	39,168	2049/5/23
RAGB 2% 07/15/26	2.0	200	199	31,356	2026/7/15
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	280	215	33,767	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	560	545	85,670	2034/5/23
RAGB 2.5% 10/20/29	2.5	200	200	31,554	2029/10/20
RAGB 2.9% 02/20/33	2.9	720	732	115,067	2033/2/20
RAGB 2.9% 02/20/34	2.9	570	578	90,785	2034/2/20
RAGB 2.9% 05/23/29	2.9	160	163	25,680	2029/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	420	426	66,983	2044/6/20
RAGB 3.15% 10/20/53	3.15	190	192	30,200	2053/10/20
RAGB 3.2% 07/15/39	3.2	130	133	20,937	2039/7/15
RAGB 3.45% 10/20/30	3.45	150	157	24,779	2030/10/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	210	243	38,286	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	770	868	136,332	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	470	483	75,912	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	540	590	92,795	2027/7/15
（フィンランド）					
国債証券					
RFGB 0% 09/15/30	－	330	288	45,231	2030/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	270	199	31,374	2036/4/15
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	240	114	17,986	2052/4/15
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	290	247	38,922	2031/9/15
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	210	138	21,809	2040/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	500	490	77,050	2026/4/15
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	180	117	18,435	2043/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	530	508	79,805	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	290	272	42,747	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	260	238	37,519	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	270	242	38,161	2031/4/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	310	269	42,373	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/27	1.375	140	137	21,614	2027/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	330	243	38,290	2047/4/15
RFGB 1.5% 09/15/32	1.5	260	240	37,703	2032/9/15
RFGB 2.5% 04/15/30	2.5	190	190	29,952	2030/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	350	333	52,312	2042/7/4
RFGB 2.75% 04/15/38	2.75	170	166	26,135	2038/4/15
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	380	386	60,643	2028/7/4
RFGB 2.875% 04/15/29	2.875	160	163	25,637	2029/4/15
RFGB 2.95% 04/15/55	2.95	160	156	24,609	2055/4/15
RFGB 3% 09/15/33	3.0	330	337	53,032	2033/9/15
RFGB 3% 09/15/34	3.0	190	193	30,440	2034/9/15
RFGB 3.2% 04/15/45	3.2	130	133	20,915	2045/4/15

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アイルランド）	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
IRISH 0% 10/18/31	－	430	365	57,433	2031/10/18
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	410	392	61,686	2027/5/15
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	400	354	55,653	2030/10/18
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	170	144	22,749	2032/10/18
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	130	103	16,270	2035/5/15
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	250	176	27,694	2041/4/22
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	380	365	57,340	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	540	532	83,617	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	510	486	76,353	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	340	310	48,694	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	240	226	35,525	2031/3/18
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	460	348	54,688	2050/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	420	373	58,648	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	560	488	76,707	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	440	441	69,334	2030/5/15
IRISH 2.6% 10/18/34	2.6	120	119	18,786	2034/10/18
IRISH 3% 10/18/43	3.0	170	173	27,290	2043/10/18
IRISH 3.15% 10/18/55	3.15	110	114	18,035	2055/10/18
（ポルトガル）					
国債証券					
PGB 0.3% 10/17/31	0.3	450	391	61,436	2031/10/17
PGB 0.475% 10/18/30	0.475	530	478	75,098	2030/10/18
PGB 0.7% 10/15/27	0.7	380	366	57,630	2027/10/15
PGB 0.9% 10/12/35	0.9	330	270	42,541	2035/10/12
PGB 1% 04/12/52	1.0	300	177	27,803	2052/4/12
PGB 1.15% 04/11/42	1.15	240	174	27,460	2042/4/11
PGB 1.65% 07/16/32	1.65	330	310	48,727	2032/7/16
PGB 1.95% 06/15/29	1.95	620	612	96,249	2029/6/15
PGB 2.125% 10/17/28	2.125	740	739	116,084	2028/10/17
PGB 2.25% 04/18/34	2.25	410	395	62,085	2034/4/18
PGB 2.875% 07/21/26	2.875	480	485	76,311	2026/7/21
PGB 2.875% 10/20/34	2.875	320	322	50,620	2034/10/20
PGB 3% 06/15/35	3.0	110	111	17,474	2035/6/15
PGB 3.5% 06/18/38	3.5	240	250	39,400	2038/6/18
PGB 3.625% 06/12/54	3.625	140	145	22,772	2054/6/12
PGB 3.875% 02/15/30	3.875	340	365	57,395	2030/2/15
PGB 4.1% 02/15/45	4.1	320	356	56,010	2045/2/15
PGB 4.1% 04/15/37	4.1	490	545	85,680	2037/4/15
PGB 4.125% 04/14/27	4.125	350	365	57,423	2027/4/14
小計				54,269,938	
（イギリス）		千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券					
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	880	789	148,351	2028/1/31
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	1,280	1,001	188,321	2031/7/31
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	140	132	24,817	2026/10/22
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	1,090	888	166,991	2030/10/22
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	1,180	1,029	193,603	2029/1/31
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,050	303	57,028	2061/10/22
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	1,030	700	131,761	2035/7/31
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	940	361	67,884	2050/10/22
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	510	242	45,537	2046/1/31
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	1,500	1,133	213,080	2033/7/31
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	820	712	133,875	2029/10/22
UKT 1% 01/31/32	1.0	1,880	1,518	285,416	2032/1/31
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	1,120	714	134,349	2039/1/31

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	480	168	31,732	2073/10/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	1,350	1,266	238,028	2027/7/22
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	1,170	535	100,629	2051/7/31
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	930	553	104,106	2041/10/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,180	1,139	214,223	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	380	203	38,332	2047/7/22
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	680	323	60,841	2053/7/31
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	480	442	83,143	2028/10/22
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	720	351	66,008	2054/10/22
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	880	377	70,978	2071/10/22
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	880	487	91,707	2049/1/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	980	482	90,791	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,110	808	152,041	2037/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	860	501	94,365	2065/7/22
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	1,240	981	184,442	2044/1/22
UKT 3.25% 01/31/33	3.25	1,760	1,630	306,497	2033/1/31
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,130	921	173,220	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	800	601	113,086	2068/7/22
UKT 3.75% 01/29/38	3.75	1,550	1,412	265,633	2038/1/29
UKT 3.75% 03/07/27	3.75	1,010	1,002	188,414	2027/3/7
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	880	714	134,364	2052/7/22
UKT 3.75% 10/22/53	3.75	1,680	1,355	254,772	2053/10/22
UKT 4% 01/22/60	4.0	710	596	112,166	2060/1/22
UKT 4% 10/22/31	4.0	520	512	96,277	2031/10/22
UKT 4% 10/22/63	4.0	660	551	103,632	2063/10/22
UKT 4.125% 01/29/27	4.125	2,010	2,010	377,901	2027/1/29
UKT 4.125% 07/22/29	4.125	1,840	1,838	345,684	2029/7/22
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	970	943	177,441	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,010	1,011	190,211	2032/6/7
UKT 4.25% 07/31/34	4.25	1,280	1,259	236,757	2034/7/31
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	670	634	119,201	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	900	907	170,702	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	800	749	140,835	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,020	918	172,674	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	810	722	135,839	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,000	881	165,643	2055/12/7
UKT 4.375% 01/31/40	4.375	670	640	120,392	2040/1/31
UKT 4.375% 07/31/54	4.375	650	584	109,857	2054/7/31
UKT 4.5% 06/07/28	4.5	1,600	1,619	304,411	2028/6/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	840	843	158,677	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	930	886	166,670	2042/12/7
UKT 4.625% 01/31/34	4.625	1,580	1,602	301,284	2034/1/31
UKT 4.75% 10/22/43	4.75	1,100	1,073	201,909	2043/10/22
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,420	1,466	275,766	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	810	813	152,860	2038/12/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,070	1,148	215,877	2028/12/7
小計				9,401,057	
(スウェーデン)		千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
国債証券					
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	2,510	2,224	30,895	2031/5/12
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	3,460	3,330	46,261	2028/5/12
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	4,280	4,036	56,068	2029/11/12
SGB 1% 11/12/26	1.0	4,150	4,085	56,745	2026/11/12
SGB 1.75% 11/11/33	1.75	2,420	2,335	32,441	2033/11/11
SGB 2.25% 05/11/35	2.25	1,050	1,049	14,574	2035/5/11
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	2,560	2,579	35,835	2032/6/1
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	2,460	2,775	38,553	2039/3/30
小計				311,374	
(ノルウェー)		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券					
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	2,370	2,031	27,450	2031/9/17
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	2,960	2,622	35,431	2030/8/19
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	2,510	2,449	33,097	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	2,680	2,582	34,887	2027/2/17
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	2,310	2,125	28,714	2029/9/6
NGB 2% 04/26/28	2.0	2,510	2,387	32,250	2028/4/26
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	2,000	1,798	24,295	2032/5/18
NGB 3% 08/15/33	3.0	2,510	2,372	32,057	2033/8/15
NGB 3.5% 10/06/42	3.5	1,200	1,168	15,781	2042/10/6
NGB 3.625% 04/13/34	3.625	1,640	1,621	21,901	2034/4/13
小計				285,868	
(デンマーク)		千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
国債証券					
DGB 0% 11/15/31	－	3,330	2,917	61,423	2031/11/15
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	3,220	1,885	39,679	2052/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	2,810	2,712	57,104	2027/11/15
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	3,000	2,811	59,187	2029/11/15
DGB 2.25% 11/15/26	2.25	910	917	19,319	2026/11/15
DGB 2.25% 11/15/33	2.25	1,920	1,946	40,965	2033/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	4,890	6,221	130,954	2039/11/15
小計				408,634	
(ポーランド)		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券					
POLGB 0% 04/25/26	－	1,000	941	35,285	2026/4/25
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	1,080	994	37,270	2026/10/25
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	2,970	2,366	88,685	2030/10/25
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	2,940	2,276	85,306	2032/4/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	2,310	2,223	83,329	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	2,260	2,120	79,459	2027/7/25
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	3,870	3,587	134,434	2028/4/25
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	4,370	3,894	145,963	2029/10/25
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	1,680	1,628	61,038	2027/5/25
POLGB 4.75% 07/25/29	4.75	1,400	1,360	50,974	2029/7/25
POLGB 5% 01/25/30	5.0	210	205	7,696	2030/1/25
POLGB 5% 10/25/34	5.0	1,480	1,391	52,166	2034/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	1,100	1,112	41,677	2029/4/25
POLGB 6% 10/25/33	6.0	1,790	1,818	68,158	2033/10/25
POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	1,530	1,631	61,128	2028/7/25
小計				1,032,576	
(オーストラリア)		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券					
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	1,030	978	92,987	2026/9/21
ACGB 1% 11/21/31	1.0	1,560	1,277	121,394	2031/11/21
ACGB 1% 12/21/30	1.0	1,480	1,252	119,042	2030/12/21
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	1,140	934	88,843	2032/5/21
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	1,190	1,021	97,149	2031/6/21
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	960	519	49,365	2051/6/21
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	1,260	1,057	100,530	2032/11/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	710	677	64,429	2028/5/21
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	620	579	55,050	2030/5/21

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	750	590	56,105	2041/5/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,130	980	93,224	2035/6/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,080	1,052	100,076	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	970	936	88,979	2028/11/21
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,080	1,029	97,831	2029/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	720	545	51,855	2047/3/21
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,120	1,017	96,715	2033/11/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,110	1,086	103,328	2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	480	416	39,555	2039/6/21
ACGB 3.5% 12/21/34	3.5	990	925	87,993	2034/12/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	780	731	69,510	2037/4/21
ACGB 3.75% 05/21/34	3.75	1,440	1,381	131,327	2034/5/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,200	1,206	114,662	2026/4/21
ACGB 4.25% 12/21/35	4.25	540	534	50,852	2035/12/21
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,340	1,367	129,954	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	1,210	1,236	117,515	2027/4/21
ACGB 4.75% 06/21/54	4.75	330	325	30,943	2054/6/21
小計				2,249,227	
(ニュージーランド)		千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
国債証券					
NZGB 0.25% 05/15/28	0.25	650	581	49,950	2028/5/15
NZGB 0.5% 05/15/26	0.5	410	394	33,895	2026/5/15
NZGB 1.5% 05/15/31	1.5	540	463	39,773	2031/5/15
NZGB 1.75% 05/15/41	1.75	260	168	14,460	2041/5/15
NZGB 2% 05/15/32	2.0	350	301	25,867	2032/5/15
NZGB 2.75% 04/15/37	2.75	350	286	24,597	2037/4/15
NZGB 2.75% 05/15/51	2.75	350	232	19,928	2051/5/15
NZGB 3% 04/20/29	3.0	490	474	40,728	2029/4/20
NZGB 3.5% 04/14/33	3.5	840	790	67,914	2033/4/14
NZGB 4.25% 05/15/34	4.25	340	334	28,742	2034/5/15
NZGB 4.25% 05/15/36	4.25	350	338	29,067	2036/5/15
NZGB 4.5% 04/15/27	4.5	560	571	49,056	2027/4/15
NZGB 4.5% 05/15/30	4.5	510	523	44,921	2030/5/15
NZGB 4.5% 05/15/35	4.5	220	219	18,821	2035/5/15
NZGB 5% 05/15/54	5.0	190	187	16,113	2054/5/15
小計				503,840	
(シンガポール)		千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券					
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	90	87	9,826	2026/11/1
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	350	326	36,542	2031/7/1
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	330	275	30,809	2050/3/1
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	400	330	37,065	2051/10/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	770	763	85,496	2026/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	450	425	47,712	2036/8/1
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	290	275	30,842	2039/7/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	280	279	31,290	2028/5/1
SIGB 2.625% 08/01/32	2.625	180	177	19,913	2032/8/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	410	406	45,568	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	300	297	33,304	2042/4/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	660	663	74,372	2029/7/1
SIGB 2.875% 08/01/28	2.875	80	80	9,009	2028/8/1
SIGB 2.875% 09/01/27	2.875	80	80	9,000	2027/9/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	360	362	40,589	2030/9/1
SIGB 3% 04/01/29	3.0	80	80	9,059	2029/4/1
SIGB 3% 08/01/72	3.0	310	328	36,754	2072/8/1

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
SIGB 3.375% 05/01/34	3.375	120	125	14,079	2034/5/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	400	417	46,731	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	580	588	65,985	2027/3/1
小計				713,955	
(マレーシア)		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
国債証券					
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	980	920	31,403	2031/4/15
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	920	921	31,435	2027/5/31
MGS 3.519% 04/20/28	3.519	400	399	13,645	2028/4/20
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	950	938	32,021	2032/7/15
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	1,180	1,186	40,488	2028/6/15
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	1,110	1,082	36,932	2040/5/22
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	670	671	22,909	2034/7/5
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	860	861	29,415	2033/4/15
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,890	1,912	65,250	2029/8/15
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	580	585	19,974	2027/3/15
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,770	1,789	61,066	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	1,140	1,151	39,284	2026/11/30
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	750	755	25,798	2026/7/15
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	1,340	1,324	45,202	2050/6/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	950	974	33,267	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,430	1,479	50,479	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	380	385	13,138	2026/4/15
MGS 4.457% 03/31/53	4.457	990	1,035	35,336	2053/3/31
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,040	1,080	36,888	2030/4/15
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	1,260	1,338	45,671	2033/11/7
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	1,060	1,149	39,222	2042/10/15
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	580	632	21,578	2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	1,160	1,253	42,771	2037/4/7
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	1,490	1,636	55,832	2038/6/8
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	950	1,064	36,311	2048/7/6
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	820	913	31,168	2043/9/30
小計				936,496	
(中国オフショア)		千オフショア人民元	千オフショア人民元		
国債証券					
CGB 1.62% 08/15/27	1.62	10,700	10,794	224,076	2027/8/15
CGB 1.67% 06/15/26	1.67	19,000	19,103	396,543	2026/6/15
CGB 1.85% 05/15/27	1.85	25,000	25,331	525,833	2027/5/15
CGB 1.99% 03/15/26	1.99	4,400	4,436	92,100	2026/3/15
CGB 2.04% 11/25/34	2.04	2,000	2,079	43,158	2034/11/25
CGB 2.11% 08/25/34	2.11	14,050	14,667	304,462	2034/8/25
CGB 2.12% 06/25/31	2.12	27,000	27,997	581,166	2031/6/25
CGB 2.18% 08/15/26	2.18	23,000	23,324	484,169	2026/8/15
CGB 2.27% 05/25/34	2.27	22,510	23,811	494,280	2034/5/25
CGB 2.28% 03/25/31	2.28	10,000	10,444	216,809	2031/3/25
CGB 2.3% 05/15/26	2.3	12,000	12,164	252,510	2026/5/15
CGB 2.35% 02/25/34	2.35	15,800	16,749	347,676	2034/2/25
CGB 2.37% 01/15/29	2.37	29,300	30,414	631,337	2029/1/15
CGB 2.37% 01/20/27	2.37	19,900	20,326	421,945	2027/1/20
CGB 2.39% 11/15/26	2.39	29,320	29,922	621,126	2026/11/15
CGB 2.4% 07/15/28	2.4	17,600	18,214	378,088	2028/7/15
CGB 2.44% 10/15/27	2.44	7,000	7,202	149,507	2027/10/15
CGB 2.46% 02/15/26	2.46	3,200	3,237	67,210	2026/2/15
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	16,380	16,811	348,962	2027/4/15
CGB 2.48% 09/25/28	2.48	10,800	11,221	232,939	2028/9/25

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千オフショア人民元	千オフショア人民元	千円	
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	22,400	23,011	477,674	2027/7/25
CGB 2.52% 08/25/33	2.52	20,700	22,182	460,467	2033/8/25
CGB 2.54% 12/25/30	2.54	28,400	30,042	623,613	2030/12/25
CGB 2.55% 10/15/28	2.55	13,800	14,385	298,602	2028/10/15
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	14,750	15,804	328,064	2032/9/1
CGB 2.6% 09/15/30	2.6	12,500	13,243	274,901	2030/9/15
CGB 2.62% 04/15/28	2.62	18,340	19,069	395,852	2028/4/15
CGB 2.62% 06/25/30	2.62	13,000	13,769	285,818	2030/6/25
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	20,000	21,087	437,730	2029/9/25
CGB 2.64% 01/15/28	2.64	11,460	11,904	247,118	2028/1/15
CGB 2.67% 05/25/33	2.67	19,900	21,514	446,590	2033/5/25
CGB 2.67% 11/25/33	2.67	12,000	13,017	270,215	2033/11/25
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	12,050	12,816	266,045	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	28,920	29,589	614,208	2026/8/12
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	12,700	13,716	284,727	2032/8/15
CGB 2.74% 08/04/26	2.74	18,000	18,398	381,911	2026/8/4
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	1,850	1,999	41,512	2032/2/17
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	33,430	35,342	733,638	2029/6/15
CGB 2.79% 12/15/29	2.79	13,840	14,730	305,771	2029/12/15
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	29,320	30,987	643,233	2029/3/24
CGB 2.8% 03/25/30	2.8	19,000	20,270	420,774	2030/3/25
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	21,000	22,866	474,665	2032/11/15
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	29,360	30,465	632,402	2027/6/4
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	5,100	5,604	116,344	2033/2/25
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	15,100	16,433	341,125	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	20,020	21,150	439,029	2028/10/14
CGB 3% 10/15/53	3.0	14,220	17,806	369,618	2053/10/15
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	15,960	16,835	349,473	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	13,850	15,130	314,070	2031/5/27
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	22,150	22,614	469,439	2026/3/11
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	8,200	10,388	215,636	2052/10/25
CGB 3.19% 04/15/53	3.19	4,600	5,914	122,774	2053/4/15
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	5,930	6,555	136,081	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	11,140	11,792	244,784	2027/12/3
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	7,020	9,151	189,974	2052/4/15
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	11,760	15,273	317,042	2050/3/16
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	6,510	8,756	181,757	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	6,850	9,444	196,051	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	10,280	14,376	298,423	2050/9/14

当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千オフショア人民元	千オフショア人民元	千円	
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	9,510	13,171	273,413	2049/7/22
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	10,580	14,991	311,196	2048/10/22
小計				21,045,681	
(イスラエル)		千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
国債証券					
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	350	337	14,353	2026/2/27
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	2,360	2,023	86,163	2030/3/31
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	1,310	1,078	45,929	2032/4/30
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	1,480	1,083	46,155	2037/5/31
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	1,710	1,635	69,652	2027/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	1,820	1,706	72,667	2028/9/28
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	890	632	26,947	2052/11/29
ILGOV 3.75% 02/28/29	3.75	1,780	1,755	74,768	2029/2/28
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	1,440	1,277	54,381	2047/3/31
ILGOV 3.75% 09/30/27	3.75	350	346	14,753	2027/9/30
ILGOV 4% 03/30/35	4.0	980	959	40,852	2035/3/30
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	1,060	1,190	50,702	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	1,550	1,602	68,253	2026/10/30
小計				665,582	
合計				184,354,824	

(注)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

〈先物取引の銘柄別期末残高〉

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	EURO-SCHATZ	67	―
	US 5YR NOTE	177	―
	EURO-BOBL FU	92	―
	EURO-BUND	188	―
	US 10YR NOTE	116	―
	US LONG BOND	122	―

(注)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

投資信託財産の構成

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	184,354,824	98.0
コール・ローン等、その他	3,707,724	2.0
投資信託財産総額	188,062,548	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(186,402,867千円)の投資信託財産総額(188,062,548千円)に対する比率は99.1%です。
(注2)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=151.30円	1カナダドル=105.69円	1メキシコペソ=7.3985円
1ユーロ=157.05円	1イギリスポンド=188.01円	1スウェーデンクローナ=13.89円
1ノルウェークローネ=13.51円	1デンマーククローネ=21.05円	1ポーランドズロチ=37.4775円
1オーストラリアドル=95.06円	1ニュージーランドドル=85.88円	1シンガポールドル=112.03円
1マレーシアリンギット=34.1256円	1オフショア人民元=20.7579円	1イスラエルシェケル=42.5826円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2025年2月7日現在
(A) 資産	**188,957,574,079円**
コール・ローン等	1,928,022,202
公社債(評価額)	184,354,824,900
未収入金	903,411,385
未収利息	1,576,156,158
前払費用	123,973,011
差入委託証拠金	71,186,423
(B) 負債	**1,384,788,542**
未払金	1,280,043,723
未払解約金	104,744,819
(C) 純資産総額(A-B)	**187,572,785,537**
元本	60,412,765,353
次期繰越損益金	127,160,020,184
(D) 受益権総口数	**60,412,765,353口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**31,049円**

■損益の状況

項目	当期 自 2024年2月8日 至 2025年2月7日
(A) 配当等収益	**4,654,834,408円**
受取利息	4,651,764,626
その他収益金	3,080,036
支払利息	△10,254
(B) 有価証券売買損益	**2,999,979,729**
売買益	6,055,342,848
売買損	△3,055,363,119
(C) 先物取引等取引損益	**△19,968,411**
取引益	74,130,831
取引損	△94,099,242
(D) その他費用	**△34,778,883**
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	**7,600,066,843**
(F) 前期繰越損益金	**116,612,294,953**
(G) 追加信託差損益金	**17,781,397,206**
(H) 解約差損益金	**△14,833,738,818**
(I) 計(E+F+G+H)	**127,160,020,184**
次期繰越損益金(I)	**127,160,020,184**

(注1)(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注3)(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は59,041,902,236円、期中追加設定元本額は8,435,901,610円、期中一部解約元本額は7,065,038,493円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC外国債券インデックスファンドL	15,056,414,647円
インデックスコレクション（外国債券）	10,183,661,006円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,614,171,890円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,098,365,716円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	4,759,200,753円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	3,692,649,674円
外国債券インデックスファンド	1,771,786,753円
DC外国債券インデックスファンド	1,727,996,323円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,189,951,789円
DCバランスファンド50	1,165,377,870円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,135,898,457円
DCバランスファンド30	939,819,243円
外国債券インデックスe	889,416,037円
VAバランス20－80（適格機関投資家専用）	855,881,833円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	686,727,849円
グローバル･インデックス･バランス･ファンド	512,125,961円
インデックスコレクション（バランス株式70）	504,207,957円
バランスVA37．5（適格機関投資家専用）	433,153,432円
DCバランスファンド70	309,474,287円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	304,554,870円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	259,056,678円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	254,994,525円
VAバランスファンド（株25／100）（適格機関投資家専用）	181,920,429円
VAバランスファンド（株50／100）（適格機関投資家専用）	157,754,583円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	151,198,289円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	143,011,632円
VAバランスファンド（株40／100）（適格機関投資家専用）	109,084,811円
VAバランスファンド（株60／100）（適格機関投資家専用）	64,164,632円
VAバランスファンド2（株40／100）（適格機関投資家専用）	57,382,395円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	47,886,417円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	46,078,377円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	43,128,666円
VAバランス50－50（適格機関投資家専用）	33,219,702円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	19,274,996円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	13,772,874円

お知らせ

該当事項はありません。